

受益者のみなさまへ

毎々、格別のお引き立てにあずかり、厚くお礼申し上げます。
さて、「フィデリティ・グローバル・ハイ・イールド・ファンド(資産成長型)」は、第9期決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

運用報告書
(全体版)

第9期(決算日 2023年3月27日)
計算期間(2022年3月29日～2023年3月27日)


■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	原則無期限です。
運用方針	<ul style="list-style-type: none">●投資信託証券*(投資対象ファンド)への投資を通じて、主として海外の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に分散投資を行い、高水準の利息等の収入を確保するとともに、値上り益の追求を目指します。●組入れを行う投資信託証券において、格付けに関しては、主に、Ba格(ムーディーズ社)以下またはBB格(S & P社)以下の格付けの事業債に投資を行い、一部、格付けを持たない債券を組入れることもあります。●組入れを行う投資信託証券において、銘柄選別に関しては、個別企業分析により判断します。個別企業分析にあたっては、アナリストによる独自の企業調査情報を活用し、個別の企業の信用分析と現地のポートフォリオ・マネージャーによる「ボトム・アップ・アプローチ」を重視した運用を行います。●投資信託証券の組入れは原則として高位を維持します。●組入れ外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。●ファンドの運用にあたっては、フィデリティ・インベストメンツ・カナダ・ユーエルシーおよびFILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッドに、運用の指図に関する権限を委託します。●資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては上記のような運用ができない場合もあります。 * 上場投資信託証券を含みます。
主要運用対象	投資信託証券(上場投資信託証券を含みます。)への投資を通じて、主として海外の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に投資を行います。
組入制限	投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時(原則3月27日。同日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の収益分配方針に基づき分配を行います。 <ul style="list-style-type: none">●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

フィデリティ・グローバル・ ハイ・イールド・ファンド (資産成長型)

〈お問合せ先〉

フィデリティ投信株式会社 カスタマー・コミュニケーション部
東京都港区六本木七丁目7番7号 TRI-SEVEN ROPPONGI

 0120-00-8051 (無料)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時

 <https://www.fidelity.co.jp/>

お客様の口座内容などに関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお尋ねください。

フィデリティ投信株式会社



■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
5期(2019年3月27日)	円 12,194	円 0	% 3.8		% 4.9	% 33.1	% 66.4	百万円 259
6期(2020年3月27日)	10,489	0	△14.0	35,466	△11.9	33.2	66.0	161
7期(2021年3月29日)	13,562	0	29.3	46,125	30.1	33.4	65.9	163
8期(2022年3月28日)	13,057	0	△3.7	46,221	0.2	35.8	63.9	139
9期(2023年3月27日)	13,168	0	0.9	46,940	1.6	33.3	66.2	124

(注) ベンチマーク：以下の各市場指標を以下の割合で合成した複合ベンチマーク(円換算)とします。

ベンチマーク	構成割合
J.P.モルガン・アジア・クレジット・インデックス・ノン・インベストメント・グレード(円換算) ^{(注)*1}	3分の1
ICE BofA グローバル・ハイ・イールド・ヨーロッパ・イシューアズ・コンストレインド・インデックス(レベル4-20%)(ユーロヘッジ・ベース)(円換算) ^{*2}	3分の1
ICE BofA USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス(円換算) ^{*2}	3分の1

(注) 2022年7月末まではICE BofA アジアン・ハイ・イールド・コーポレート・コンストレインド・ブレンデッド・インデックス(レベル4-20%)(円換算)でした。ベンチマーク欄はこれらを連続させて計算しています。

*1 この情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。このインデックスは使用許諾を得て使用しています。
J.P.モルガンによる書面による事前の承諾なくこのインデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。
Copyright © 2022 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

*2 ICE®はICE Data Indices, LLCまたはその関連会社の登録商標です。BofA®はバンク・オブ・アメリカ・コーポレーションおよびその関連会社(BofA)によってライセンス供与されたバンク・オブ・アメリカ・コーポレーションの登録商標であり、BofAの事前の承認なしに使用することはできません。ICE BofAはICE BofA indexを現状有姿の状態でのライセンス供与しており、同インデックスに関し保証したり、同インデックスおよびそこに反映され、関連している、あるいはそこから派生しているいかなるデータに関して、その適切性、品質、正確性、適時性、完全性を保証するものではありません。またICE BofAは、それらの利用に際し責任を負うものではなく、フィデリティ投信株式会社あるいは同社の商品やサービスにつき、スポンサー提供、支持、もしくは推奨するものではありません。

This Japanese translation of the disclaimer is for informational purposes only, and the English language disclaimer, which is available upon request, controls with respect to ICE Data Indices, LLC and the ICE BofA Indices.

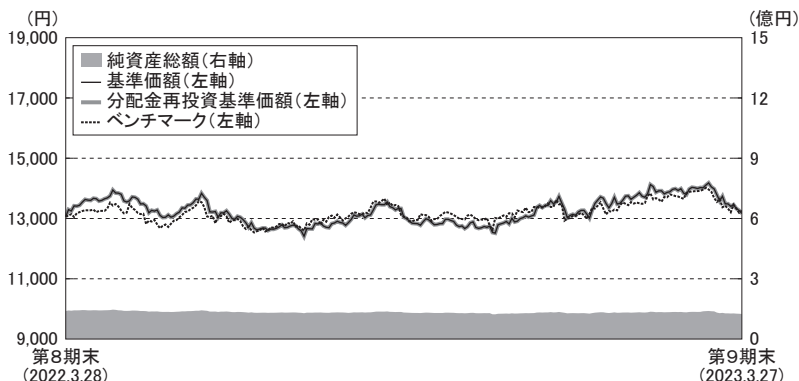
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2022年3月28日	円 13,057	% —		% —	% 35.8	% 63.9
3月末	13,418	2.8	46,204	△0.0	34.6	64.8
4月末	13,585	4.0	47,723	3.2	33.3	66.1
5月末	13,353	2.3	46,434	0.5	33.5	65.8
6月末	12,962	△0.7	45,103	△2.4	34.3	65.3
7月末	12,655	△3.1	45,184	△2.2	35.7	64.1
8月末	13,090	0.3	46,534	0.7	34.0	65.8
9月末	12,835	△1.7	45,839	△0.8	33.9	65.2
10月末	12,854	△1.6	46,477	0.6	35.6	63.9
11月末	13,087	0.2	47,294	2.3	32.8	66.5
12月末	13,150	0.7	46,002	△0.5	31.3	68.2
2023年1月末	13,855	6.1	47,808	3.4	30.4	69.1
2月末	14,034	7.5	49,191	6.4	31.3	68.5
(期末) 2023年3月27日	13,168	0.9	46,940	1.6	33.3	66.2

(注) 騰落率は期首比です。

■運用経過の説明

●基準価額等の推移



第9期首: 13,057円

第9期末: 13,168円(既払分配金0円)

騰落率: 0.9%(分配金再投資ベース)

(注)分配金再投資基準価額およびベンチマークは、2022年3月28日の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。

※ベンチマークは「複合ベンチマーク(円換算)」です。

●基準価額の主な変動要因

当期におけるフィデリティ・グローバル・ハイ・イールド・ファンド(資産成長型)の騰落率は、+0.9%でした。

当ファンドは、「フィデリティ・ファンズーアジアン・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)」、「フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)」、「フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)(国内証券投資信託)」の各投資信託証券への投資を通じて、主として海外の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に分散投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行っています。

当期を通してみると、米国、欧州のハイ・イールド社債のスプレッド(上乘せ利回り)は拡大し、基準価額に対してマイナスに作用し、アジアは小幅に縮小し概ねプラスに作用しました。各ファンドの保有債券によるクーポン収入は、基準価額に対してプラスに作用しました。この間、米国およびドイツの長期金利は上昇したことから、基準価額に対してマイナスに作用しました。なお、当ファンドは為替ヘッジを行っておりませんので、円相場の変動が基準価額に反映されます。当期につきましては、円安・米ドル高、円安・ユーロ高となったため、ファンドの基準価額にとってプラスに作用しました。

●投資環境

当期の世界のハイ・イールド債券市場における各地域・国別市場指標の騰落率は以下の通りとなりました。

地域・国	市場指標	騰落率
アジア	J. P. モルガン・アジア・クレジット・インデックス・ノン・インベストメント・グレード(米ドルベース)	-1.9%
欧州	ICE BofA グローバル・ハイ・イールド・ヨーロッパ・イシューズ・コンストレインド・インデックス(レベル4-20%)(ユーロヘッジ・ベース)	-5.5%
米国	ICE BofA USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス(米ドルベース)	-4.1%

当期は、期前半は、新型コロナワクチンの普及に伴う世界的な経済の正常化や地政学リスク、期後半は、インフレ高進、各国・地域の金融当局の金融政策動向などに注目が集まりました。

米国債券市場では、3月初旬、ウクライナ情勢による地政学リスクが台頭し不確実性が急速に高まった後、インフレ高進を受け、3月の米連邦公開市場委員会(FOMC)で、0.25%の利上げが決定され、その流れを受けて始まりました。それ以降も、米国では、継続的な利上げが行われました。米国経済は、労働市場の堅調さが維持されるなど、総じて底堅い景況感となり、金融当局のタカ派的な姿勢を下支えしました。米連邦準備制度理事会(FRB)は、インフレ抑制を最優先とする姿勢を明確にしてきたこともあり、金利上昇圧力が続きました。その間、市場ではウクライナ情勢の長期化や米中関係の緊張の高まり、引き締めによる景気後退懸念の強まりなど不確実性が台頭する時期もみられ、5月や6月中旬から7月下旬などでは長期金利は低下傾向となりました。しかし夏以降、インフレ率上昇に鈍化の兆しが見え始めてきたことから、10月後半以降は、利上げ鈍化観測が強まり、金利低下に転じました。米国の中長期的な景気減速懸念も材料視され始めました。2月になると、労働市場の堅調さなどにより米景気の底堅さが示されたことや、金融当局のインフレ抑制姿勢が再確認されたことなどが、再び金利上昇圧力となりました。3月になると、米欧金融機関の破綻や経営不安が、金融システム不安の懸念を高め、リスク回避の動きが強まり、金利低下圧力となりました。

欧州債券市場も、米国同様、インフレ高進が欧州中央銀行(ECB)の政策転換を後押しし、欧州中央銀行(ECB)は、インフレ抑制を優先する姿勢を強めていきました。7月には、6月に示唆していた水準を超える0.50%の利上げに動くなど、高止まりするインフレへの対処を強めました。その後も、ECBは、インフレ抑制を優先する姿勢を強め、利上げを継続しました。12月になると、米国には遅れながらも、インフレ率上昇圧力の鈍化がみられ始め、景気減速懸念が強まり始めました。しかし、ECBの引き締め姿勢継続が、長期金利の上昇圧力につながりました。英国では、インフレ抑制対応から、2021年12月から利上げサイクルとなりました。8月、9月の利上げでは、利上げ幅を0.50%と拡大し、より強固なインフレ抑制姿勢を示しました。一方、エネルギー価格高騰の産業に与える影響が強く意識されたことや首相交代などによる政治的な混乱などから、9月から10月にかけては、長期金利の大幅な上昇がみられました。その後は、他地域同様、インフレ抑制姿勢を維持している金融当局の金融政策と景況感との綱引きによる金利動向となりました。3月になると、米欧金融機関の破綻や経営不安が、金融システム不安の懸念を高め、欧州市場においても、リスク回避の動きが強まり、金利低下圧力となりました。

ハイ・イールド市場は、期前半、金融政策のインフレ対応の加速などにより、リスク資産全般が軟調となる流れを受けて、総じて調整する動きとなりました。資産のバリュエーションの観点では、調整が進むにつれ、割安感がみられる水準となってきたものの、新型コロナの感染状況、金融政策正常化の加速などが重石となり、スプレッド(上乗せ利回り)は拡大しました。インフレ高進が継続し、金融当局の姿勢がインフレ抑制を優先する

姿勢を強めたことも、投資家心理の悪化要因となりました。期後半になると、インフレの鈍化傾向やそれに伴う金融引き締めスピードの抑制期待などから、前期までの調整から一転し、総じて堅調となり、スプレッドは縮小しました。長期金利上昇圧力の緩和もこの動きを下支えしました。しかしながら、3月に、金融システム不安への懸念が高まると、リスク回避の動きからスプレッドは拡大しました。アジア・ハイ・イールド市場では、期前半、中国の景気減速懸念、IT企業などに対する規制強化や不動産大手企業の信用懸念などが材料視され、投資家心理は悪化しました。期後半になると、米中の緊張の高まりやなど不確実性が残る状況下、中国政府の景気に配慮した柔軟な政策対応などが好感され、投資家心理は改善に向かいました。期を通してみると、米国およびドイツの10年国債利回りは上昇しました。また、米国、欧州ハイ・イールド社債のスプレッドは拡大し、アジアは小幅に縮小しました。

●ポートフォリオ

当ファンドは、以下の投資信託証券を主要な投資対象とし、配当等収益の確保と投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いました。

- ・フィデリティ・ファンズーアジア・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)
- ・フィデリティ・ファンズーヨーロピアン・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)
- ・フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)(国内証券投資信託)

各投資信託証券の運用状況は以下の通りです。

【フィデリティ・ファンズーアジア・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)】

当期中、当ファンドの騰落率は-4.8%(米ドルベース、当期末前日基準)となりました。当ファンドは、主として活動の大半をアジアで営んでいる発行体が発行する高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に投資を行い、高水準の利息等の収入を確保するとともに、値上り益の追求を目指す運用を行います。ポートフォリオ構築に当たっては、アナリストによる発行体の信用リスク調査やバリュエーション分析、トレーダーからのマーケット情報を活用し運用を行います。また、ファンドのリスクを抑えるため、分散投資を基本としています。当期もこうした基本方針に沿った運用を行いました。

【フィデリティ・ファンズーヨーロピアン・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)】

当期中、当ファンドの騰落率は-7.0%(ユーロベース、当期末前日基準)となりました。当ファンドは、本店所在地が西ヨーロッパ、中央ヨーロッパ、東ヨーロッパ(ロシアを含む)にあるか、あるいは主たる業務活動がそれらの地域で行われている企業が発行する高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に主として投資を行い、高水準の利息等の収入を確保するとともに、値上り益の追求を目指す運用を行います。ポートフォリオ構築に当たっては、アナリストによる発行体の信用リスク調査やバリュエーション分析、トレーダーからのマーケット情報を活用し運用を行います。また、ファンドのリスクを抑えるため、分散投資を基本としています。当期もこうした基本方針に沿った運用を行いました。

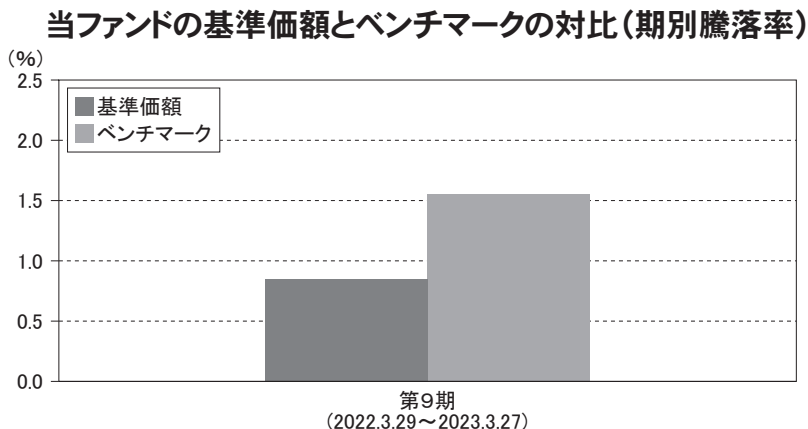
【フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)(国内証券投資信託)】

当期中、当ファンドの騰落率は+3.5%(円ベース、当期末基準)となりました。当ファンドは、フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主に米ドル建て高利回り事業債(ハイ・イールド債

券)に投資を行うことにより、高水準の利息等の収入を確保するとともに、値上り益の追求を目指します。ポートフォリオ構築に当たっては、アナリストによる企業調査情報を活用した発行体企業の調査・分析の結果、ファンドの保有、非保有銘柄の選別を行います。また、ファンドのリスクを抑えるため、分散投資を行うことを基本としています。当期もこうした基本方針に沿った運用を行いました。

●ベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



(注)基準価額の騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。

※ベンチマークは「複合ベンチマーク(円換算)」です。

当期の当ファンドの騰落率は、ベンチマーク騰落率の+1.6%を下回りました。フィデリティ・USハイ・イールド・ファンドは、市場指標を上回りました。一方、フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド(ユーロベース)、フィデリティ・ファンズーアジア・ハイ・イールド・ファンド(米ドルベース)は、市場指標を下回りました。フィデリティ・ファンズーアジア・ハイ・イールド・ファンドは米ドル建てのファンドであり、フィデリティ・USハイ・イールド・ファンドは米ドル建て資産に投資を行っていることから、対円での米ドル高は当ファンドの基準価額にプラスに寄与しました。フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンドはユーロ建てのファンドであるため、対円でのユーロ高は当ファンドの基準価額にプラスに寄与しました。

■ 分配金

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきます。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

● 分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

項目	第9期	
	2022年3月29日～2023年3月27日	
当期分配金	0	—%
(対基準価額比率)	—	—
当期の収益	—	—
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	3,918	

- * 「当期の収益」および「当期の収益以外」は円未満切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
- * 当期分配金の「対基準価額比率」は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- * 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」が当該決算期末日時点の基準価額を上回ることがありますが、実際には基準価額を超えて分配金が支払われることはありません。

■ 今後の運用方針

フィデリティ・グローバル・ハイ・イールド・ファンド(資産成長型)は、引き続き、各投資信託証券への投資を通じて、主として海外の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に分散投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行ってまいります。各投資信託証券への配分比率は、投資信託財産に対して概ね以下の比率を基本とし、当該基本配分から大きく乖離しないように運用します。原則として、戦術的な資産配分は行いません。ただし、運用環境の変化により、基本配分比率を変更する場合があります。

投資信託証券	基本配分比率
フィデリティ・ファンズーアジア・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)	1/3
iシェアーズUSDアジア・ハイ・イールド・ボンド・インデックスETF(シンガポール籍外国証券投資信託)	
フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド(ルクセンブルグ籍証券投資法人)	1/3
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)(国内証券投資信託)	1/3

主要な投資対象である、世界のハイ・イールド債券市場における市場環境の見通しは以下の通りです。米国債券市場では、堅調な労働市場を背景とした底堅い経済状況が続いているものの、企業景況感の悪化やインフレ圧力に鈍化の兆しがみられることから、市場では今後の利上げ停止時期に注目が集まっています。しかしながら、米連邦準備制度理事会(FRB)は、インフレ動向の不確実性なども考慮し利上げを続ける姿勢を維持しており、中央銀行と市場の見通しの乖離から当面は長期金利の変動が大きくなる可能性があります。今後について、インフレ抑制が思うように進まないリスクや、一部の金融機関の経営不安などが先行きの不確実性要因となっており、そのような要因の影響および動向を注意深く見ていきます。

ユーロ圏では、高インフレなどを背景に、金融政策動向への注目が集まっています。欧州中央銀行(ECB)は、景気下振れを想定しながらも、インフレ抑制姿勢を強めています。英国も、継続的な利上げにより、インフレ抑制姿勢を維持しています。ウクライナ情勢の長期化は、エネルギー価格の上昇など欧州地域に直接的な影響を与えており、地域全般の大きな不確実性要因となっています。したがって、欧州地域では、金融政策と景

気のバランスなど難しいかじ取りを強いられています。インフレ抑制が想定通り進まないリスクも残るため、動向を注意深く見ていく必要があります。

各国のハイ・イールド債券市場は、インフレ率の高止まりや主要国の継続的な利上げなどが景気減速リスクの懸念を強め、短期的な不確実性要因となっています。また、ウクライナ情勢の長期化など地政学リスクによる要因からインフレ抑制が想定通り進まない可能性も残るなど、市場のボラティリティが高まりやすい状況が継続するとみています。したがって、流動性を十分考慮し、慎重な銘柄選択を進めていきます。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	2022年3月29日～2023年3月27日		
	金額	比率	
(a)信託報酬	113円	0.849%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,253円です。
（投信会社）	(4)	(0.033)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(105)	(0.795)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの 管理及び事務手続き等の対価
（受託会社）	(3)	(0.021)	運用財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)売買委託手数料	—	—	(b)売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c)有価証券取引税	—	—	(c)有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d)その他費用	14	0.106	(d)その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（保管費用）	(1)	(0.007)	保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外 における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。
（監査費用）	(1)	(0.006)	監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用
（その他）	(12)	(0.093)	その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、 印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含ま れます。
合計	127	0.955	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

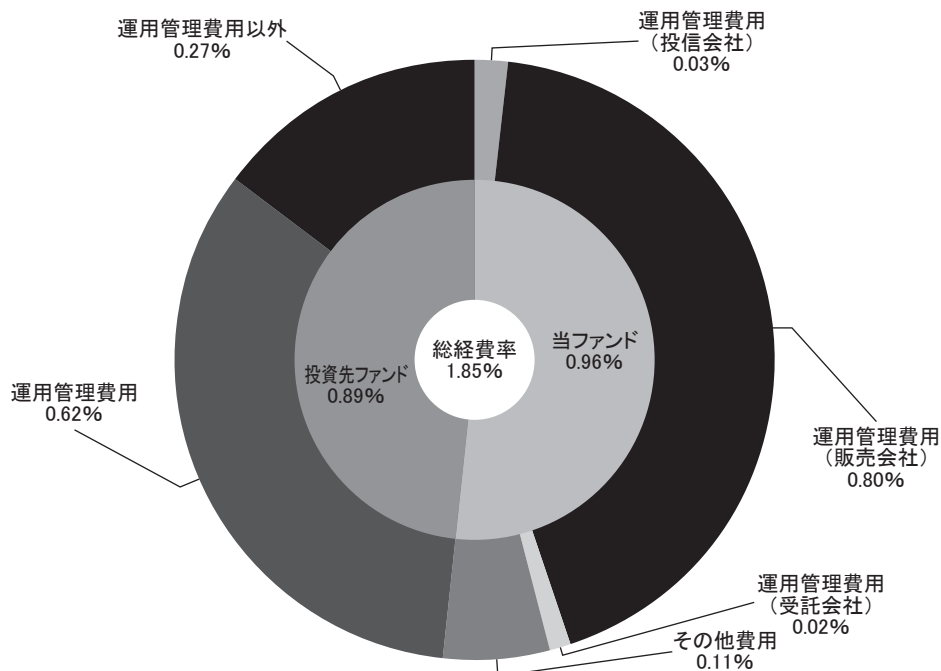
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(参考情報)

●総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.85%です。



総経費率(①+②+③)	1.85%
①当ファンドの費用の比率	0.96%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.27%

(注1)①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等(有価証券届出書、目論見書、運用報告書等)の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4)各比率は、年率換算した値です。

(注5)投資先ファンドとは、当ファンドが実質的に組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注6)①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注7)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■ 売買及び取引の状況 (2022年3月29日から2023年3月27日まで)

● 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	単位数又は口数	金 額	単位数又は口数	金 額
国内	千口	千円	千口	千円
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド (適格機関投資家専用)	4,587.453 (-)	3,659 (-)	13,984.258 (-)	11,221 (-)
外国				
FF-ASIAN HIGH YIELD FUND CLASS A-ACC-USD	千口 1.43383 (-)	千アメリカ・ドル 16 (-)	千口 2.80676 (-)	千アメリカ・ドル 38 (-)
FF-EUROPEAN HIGH YIELD FUND CLASS A-ACC-EURO	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 1.34622 (-)	千ユーロ 27 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付 () 内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付 () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年3月29日から2023年3月27日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託受益証券	百万円 3	百万円 3	% 100.0	百万円 11	百万円 11	% 100.0
投資証券	2	2	100.0	8	8	100.0
為替	2	2	100.0	9	9	95.3

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
そ の 他 有 価 証 券	百万円 2	百万円 8	百万円 82

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当	期
売 買 委 託 手 数 料 総 額(A)		-千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額(B)		-
(B) / (A)		-

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、フィデリティ証券株式会社、FIL DISTRIBUTORS、FIL LUXEMBOURG SAです。

■組入資産の明細（2023年3月27日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	単位数又は口数	評 価 額	比 率
ファイデリティ・USハイ・イールド・ファンド（適格機関投資家専用）	千口 55,255.305	千円 41,601	% 33.3
合 計	55,255.305	41,601	33.3

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末			
	単位数又は口数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
FF-ASIAN HIGH YIELD FUND CLASS A-ACC-USD	千口 23.44925	千アメリカ・ドル 313	千円 41,022	% 32.8
FF-EUROPEAN HIGH YIELD FUND CLASS A-ACC-EURO	14.83566	千ユーロ 296	41,655	33.3
合 計	38.28491	—	82,677	66.2

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成（2023年3月27日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 41,601	% 33.1
投 資 証 券	82,677	65.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,246	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	125,525	100.0

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、3月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.65円、1ユーロ=140.67円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(82,796千円)の投資信託財産総額(125,525千円)に対する比率は、66.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年3月27日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資 産	125,525,288	
コール・ローン等	830,845	
投資信託受益証券(評価額)	41,601,719	
投資証券(評価額)	82,677,367	
未 収 配 当 金	309,429	
そ の 他 未 収 収 益	105,928	
(B) 負 債	613,333	
未 払 信 託 報 酬	548,837	
そ の 他 未 払 費 用	64,496	
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	124,911,955	
元 本	94,857,475	
次 期 繰 越 損 益 金	30,054,480	
(D) 受 益 権 総 口 数	94,857,475口	
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	13,168円	

(注1) 当期における期首元本額106,991,136円、期中追加設定元本額5,625,735円、期中一部解約元本額17,759,396円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年3月29日 至2023年3月27日

項 目	当 期	円
(A) 配 当 等 収 益	2,898,561	
受 取 配 当 金	2,509,157	
受 取 利 息	335	
そ の 他 収 益 金	389,069	
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△848,526	
売 買 益 損	5,616,255	
売 買 損	△6,464,781	
(C) 信 託 報 酬 等	△1,275,002	
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	775,033	
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	13,800,125	
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,479,322	
(配 当 等 相 当 額)	(10,516,074)	
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,963,248)	
(G) 合 計(D+E+F)	30,054,480	
次 期 繰 越 損 益 金(G)	30,054,480	
追 加 信 託 差 損 益 金	15,479,322	
(配 当 等 相 当 額)	(10,516,074)	
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,963,248)	
分 配 準 備 積 立 金	22,539,259	
繰 越 損 益 金	△7,964,101	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、純資産総額に対して年0.30%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期	円
(a) 費用控除後の配当等収益	1,623,559円	
(b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	
(c) 収益調整金	14,630,796円	
(d) 分配準備積立金	20,915,700円	
(e) 分配可能額(a+b+c+d)	37,170,055円	
1 万 口 当 たり 分 配 可 能 額	3,918.52円	
(f) 分配金額	0円	
1 万 口 当 たり 分 配 金(税引前)	0円	

ご参考として以下に、フィデリティ・グローバル・ハイ・イールド・ファンド(資産成長型)が組入れている各投資信託証券の直前の作成期における運用内容を掲載いたします。

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーアジアン・ハイ・イールド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

設定形態	ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て
投資目的	主として、活動の大半がアジアで営まれている発行体の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に投資を行い、高水準の利息等の収入を確保するとともに、値上り益の追求を目指します。
決算日	4月30日

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

通貨	米ドル
投資収益	
受取配当金および受取利息	243,372,127
スワップ取引に係る受取利息	67,679,545
デリバティブ収益	—
雑益	—
純利益	311,051,672
費用	
運用報酬	39,527,273
管理費	11,915,987
国税	2,031,669
保管費用	435,077
販売手数料	396,893
成功報酬	—
その他費用	574,483
費用合計	54,881,382
スワップ取引に係る支払利息	32,676,790
デリバティブ費用	166,715
差金決済取引に係る財務費用	—
還付ブローカー費用	—
管理費用の払戻	—
払戻費用	—
費用還付	—
総費用	87,724,887
純投資収益(損失)	223,326,785
有価証券に係る実現純(損)益	(1,513,145)
外貨取引に係る実現純(損)益	(129,600)
差金決済取引に係る実現純(損)益	—
外国為替予約取引に係る実現純(損)益	(17,399,999)
オプション取引に係る実現純(損)益	—
先物取引に係る実現純(損)益	(31,545)
スワップ取引に係る実現純(損)益	(997,046)
有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額	(1,459,806,210)
外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額	(464,719)
差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額	—
外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額	(39,043,051)
オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額	—
先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額	(10,883,489)
スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額	(56,132,948)
運用実績	(1,363,074,967)
受益者への分配金	(183,441,369)
設定解約	
当期設定額	801,291,473
当期解約額	(1,332,998,457)
調整勘定	(11,660,483)
設定解約に伴う増加(減少)額	(543,367,467)
純増加(減少)	(2,089,883,803)
純資産額	
期首	5,190,756,954
期末	3,100,873,151

投資資産明細表

2022年4月30日現在

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
公認の証券取引所で取引される証券					
エネルギー					
Periama Holdings 5.95% 19/04/2026	US	USD	30,264,734	29,822,869	0.96
Thaioil Treasury Centre 3.75% 18/06/2050 Reg S	TH	USD	23,092,404	16,427,878	0.53
Mongolian Mining 9.25% 15/04/2024 Reg S	SU	USD	13,222,282	9,524,274	0.31
Thaioil Treasury Centre 4.875% 23/01/2043 Reg S	TH	USD	8,094,198	7,171,327	0.23
Denbury	US	USD	81,471	5,382,786	0.17
				68,329,134	2.20
公益事業					
Greenko Investment 4.875% 16/08/2023 Reg S	MU	USD	30,643,948	30,345,170	0.98
ReNew Power 5.875% 05/03/2027 Reg S	IN	USD	29,403,478	28,014,164	0.90
Greenko Solar Mauritius 5.95% 29/07/2026 Reg S	MU	USD	26,106,637	25,584,505	0.83
China Oil & Gas Group 4.70% 30/06/2026	BM	USD	26,151,308	25,137,945	0.81
Greenko Solar Mauritius 5.55% 29/01/2025 Reg S	MU	USD	22,103,156	21,814,709	0.70
JSW Hydro Energy 4.125% 18/05/2031 Reg S	IN	USD	24,730,852	21,562,088	0.70
GCL New Energy Holdings 10.00% 30/01/2024	BM	USD	14,657,589	13,851,422	0.45
India Green Power Holdings 4.00% 22/02/2027 Reg S	MU	USD	12,494,705	10,880,389	0.35
Greenko Pow 4.30% 13/12/2028 Reg S	MU	USD	9,943,875	8,787,900	0.28
India Clean Energy Holdings 4.50% 18/04/2027 Reg S	MU	USD	9,849,840	8,446,238	0.27
Star Energy Geothermal 6.75% 24/04/2033 Reg S	VG	USD	6,996,741	7,285,636	0.23
SMC Global Power Holdings 5.95% VRN (Perpetual)	PH	USD	4,742,516	4,487,606	0.14
Pakistan Wat. & Pow. Dev Auth 7.50% 04/06/2031	PK	USD	4,294,977	2,768,113	0.09
				208,965,885	6.74
素材					
ENN Clean Energy 3.375% 12/05/2026 Reg S	VG	USD	51,343,486	47,182,337	1.52
ABJA Investment 5.45% 24/01/2028	SG	USD	37,525,156	37,137,260	1.20
JSW Steel 5.375% 04/04/2025	IN	USD	22,396,396	22,228,423	0.72
West China Cement 4.95% 08/07/2026	GB	USD	15,565,865	14,111,235	0.46
Vedanta Resources 6.125% 09/08/2024 Reg S	GB	USD	15,902,932	13,350,273	0.43
JSW Steel 5.95% 18/04/2024	IN	USD	10,327,740	10,508,476	0.34
JSW Steel 5.05% 05/04/2032 Reg S	IN	USD	8,937,818	7,665,837	0.25
Vedanta Resources 6.375% 30/07/2022 Reg S	GB	USD	7,499,497	7,495,035	0.24
JSW Steel 3.95% 05/04/2027 Reg S	IN	USD	6,178,951	5,512,877	0.18
Mongolian Mining 0.00% (Perpetual)	KY	USD	5,876,280	2,379,893	0.08
				167,571,646	5.40
資本財・サービス					
Cliffon 6.25% 25/10/2025 Reg S	MU	USD	25,148,389	23,798,675	0.77
China Singyes Energy Hldgs 6.00% 19/12/2022 Reg S	BM	USD	13,368,424	12,761,831	0.41
CAR 8.875% 10/05/2022	KY	USD	10,481,047	10,300,616	0.33
Blue Skyview 15.758% (Perpetual) (Defaulted)	VG	USD	31,884,046	7,611,997	0.25
eHi Car Services 7.75% 14/11/2024	KY	USD	9,079,891	7,105,015	0.23
ITNL Offshore 7.50% 18/01/2021 (Defaulted)	SG	CNY	34,056,642	948,731	0.03
China City Int'l 5.35% 03/07/2017 (Defaulted)	HK	CNY	174,545	795	0.00
				62,527,660	2.02

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
情報技術					
Network i2i 5.650% VRN (Perpetual) Reg S	MU	USD	52,831,608	52,122,079	1.68
Lenovo Group 3.375% 24/01/2024	HK	USD	29,341,140	36,588,401	1.18
Network i2i 3.975% VRN (Perpetual) Reg S	MU	USD	36,951,105	34,186,239	1.10
Weimob Investment 9.12% 07/06/2026	VG	USD	20,006,929	13,984,843	0.45
Tsinghua Unic 4.75% 31/01/2021 (Defaulted)	VG	USD	10,206,790	5,894,421	0.19
Nuoxi Capital 5.35% 24/01/2023 (Defaulted)	VG	USD	11,139,252	2,191,091	0.07
				144,967,074	4.68
一般消費財・サービス					
Melco Resorts Finance 5.375% 04/12/2029 Reg S	KY	USD	74,901,373	60,311,335	1.94
Studio City Finance 6.50% 15/01/2028 Reg S	VG	USD	41,250,858	32,435,962	1.05
Wynn Macau 5.625% 26/08/2028 Reg S	KY	USD	34,726,205	27,737,036	0.89
Rakuten Group 5.125% VRN (Perpetual) Reg S	JP	USD	19,889,205	18,372,653	0.59
Studio City Finance 6.00% 15/07/2025 Reg S	VG	USD	21,254,189	17,953,839	0.58
MGM China Holdings 5.25% 18/06/2025 Reg S	KY	USD	19,610,036	17,710,313	0.57
Wynn Macau 5.50% 01/10/2027 Reg S	KY	USD	14,067,943	11,380,193	0.37
Meituan 3.08% 27/04/2027	KY	USD	10,724,912	9,218,062	0.30
Li & Fung 5.25% (Perpetual) EMTN	BM	USD	13,626,873	8,567,897	0.28
Meituan 3.23% 27/04/2028	KY	USD	9,492,738	7,845,748	0.25
Baoxin Auto Finance I 9.109% VRN (Perpetual)	VG	USD	12,429,532	6,774,095	0.22
MGM China Holdings 5.875% 15/05/2026 Reg S	KY	USD	4,229,446	3,738,302	0.12
Future Retail 5.60% 22/01/2025 Reg S (Defaulted)	IN	USD	8,065,088	1,629,148	0.05
Top Wise Excellence 6.00% 16/03/2020 (Defaulted)	VG	USD	24,386,631	1,097,398	0.04
Graha Andrasentra Propertindo	ID	IDR	211,367,559	728,218	0.02
LS Finance 4.80% 18/06/2026	VG	USD	395,635	352,610	0.01
LS Finance 2017 4.875% 15/07/2024 EMTN	VG	USD	186,181	175,243	0.01
REXLot Holdings 4.50% 17/04/2019 (Defaulted)	BM	HKD	6,881,671	87,703	0.00
Melco Resorts Finance 5.75% 21/07/2028 Reg S	KY	USD	82,182	68,663	0.00
REXLot Holdings 6.00% 28/04/2017 (Defaulted)	BM	HKD	2,646,796	33,732	0.00
				226,218,150	7.30
生活必需品					
SSMS Plantation Holdings 7.75% 23/01/2023	SG	USD	14,942,326	9,114,819	0.29
				9,114,819	0.29
金融					
Fortune Star 6.85% 02/07/2024	VG	USD	48,157,979	45,622,461	1.47
Vedanta Res. Fin. II 8.95% 11/03/2025 Reg S	GB	USD	43,363,916	41,275,076	1.33
ICB China 3.20% VRN (Perpetual)	CN	USD	41,122,303	39,123,925	1.26
Bangkok Bank 5.00% VRN (Perpetual) Reg S	TH	USD	30,540,012	29,876,683	0.96
Bank of Communications 3.80% VRN (Perpetual)	CN	USD	27,743,799	27,519,997	0.89
NWD Finance BVI 4.125% VRN (Perpetual)	VG	USD	29,814,981	27,243,439	0.88
NWD Finance 5.25% VRN (Perpetual)	VG	USD	26,288,991	25,894,656	0.84
Axis Bank Gift City 4.10% VRN (Perpetual) Reg S	IN	USD	23,712,579	21,840,037	0.70
Bank of East Asia 5.875% VRN (Perpetual)	HK	USD	16,410,506	16,554,098	0.53
Fortune Star 6.75% 02/07/2023	VG	USD	15,845,392	15,449,257	0.50
Bangkok Bank HK 3.466% VRN 23/09/2036 Reg S	TH	USD	17,744,613	15,275,094	0.49
Mongolian Mortgage Hfc 8.85% 08/02/2024 Reg S	MN	USD	16,749,057	14,886,902	0.48

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
ANZ 6.75% VRN (Perpetual) Reg S	AU	USD	14,136,345	14,819,625	0.48
Fortune Star 5.95% 29/01/2023	VG	USD	11,516,093	11,372,142	0.37
Fortune Star BVI 5.05% 27/01/2027	VG	USD	12,331,057	10,488,797	0.34
Asahi Mutual Life Insurance 4.10% VRN (Perpetual)	JP	USD	11,309,000	10,476,883	0.34
Fortune Star 5.00% 18/05/2026	VG	USD	10,913,135	9,431,131	0.30
RKP Overseas Finance 2016 7.950% (Perpetual)	VG	USD	11,672,163	7,486,058	0.24
Tuspark Forward 6.95% 13/05/2024	VG	USD	18,828,006	7,154,642	0.23
Tianjin State-OCI. & Management. 1.60% 17/12/2039*	CN	USD	32,734,889	7,038,001	0.23
Fortune Star 5.95% 19/10/2025	VG	USD	6,622,701	6,039,903	0.19
Tuspark Forward 7.95% 13/05/2024 (Defaulted)	VG	USD	12,068,054	4,585,861	0.15
Vedanta Res. Fin. II 13.875% 21/01/2024 Reg S	GB	USD	4,279,666	4,448,520	0.14
Yihua Overseas Invest 8.50% 23/10/2020 (Defaulted)	VG	USD	22,696,697	2,961,465	0.10
Unigroup Intl Hldings 6.00% 10/12/2020 (Defaulted)	VG	USD	7,325,269	2,881,252	0.09
Pearl Holding III 9.00% 22/10/2025 Reg S	KY	USD	5,936,987	2,167,000	0.07
Chong Hing Bank 5.70% VRN (Perpetual) EMTN	HK	USD	697,453	699,196	0.02
Bank of East Asia 5.825% VRN (Perpetual) EMTN	HK	USD	133,818	134,320	0.00
Wealth Driven 5.50% 17/08/2023	VG	USD	122,909	121,372	0.00
				422,867,793	13.64
不動産					
China SCE Group Holdings 7.00% 02/05/2025	KY	USD	66,687,830	41,346,455	1.33
Sino-Ocean Land Treasure III 4.90% VRN (Perpetual)	VG	USD	47,466,218	33,107,687	1.07
China SCE Group Holdings 7.25% 19/04/2023	KY	USD	41,692,654	32,937,196	1.06
New Metro Global 6.80% 05/08/2023	VG	USD	35,964,959	25,894,770	0.84
China SCE Group Holdings 7.375% 09/04/2024	KY	USD	37,351,801	25,772,743	0.83
CIFI Holdings Group 5.25% 13/05/2026	KY	USD	30,432,440	23,432,979	0.76
NWD 4.50% 19/05/2030 EMTN	VG	USD	25,637,421	23,081,428	0.74
RKPF Overseas 5.125% 26/07/2026	VG	USD	31,130,786	22,592,156	0.73
CIFI Holdings Group 6.55% 28/03/2024	KY	USD	24,604,557	20,926,176	0.67
Yanlord Land HK Co 6.75% 23/04/2023	HK	USD	20,270,014	19,965,964	0.64
Seazen Group 6.45% 11/06/2022	KY	USD	20,319,469	19,303,495	0.62
Times China Holdings 5.55% 04/06/2024	KY	USD	36,072,220	19,118,277	0.62
RKI Overseas Finance 2017 A 7.00% (Perpetual)	VG	USD	26,807,011	17,290,522	0.56
Theta Capital 8.125% 22/01/2025	SG	USD	17,032,411	17,117,574	0.55
Powerlong Real Estate Holdings 4.00% 25/07/2022	KY	USD	21,632,306	16,440,552	0.53
Seazen Group 4.45% 13/07/2025	KY	USD	24,083,053	16,075,438	0.52
Powerlong Real Estate Holdings 7.125% 08/11/2022	KY	USD	27,237,709	15,934,060	0.51
Seazen Group 6.00% 12/08/2024	KY	USD	22,381,190	15,890,645	0.51
RKPF Overseas 2019 6.00% 04/09/2025	VG	USD	20,637,516	15,743,572	0.51
China SCE Group Holdings 6.00% 04/02/2026	KY	USD	26,442,935	15,667,439	0.51
New Metro Global 4.80% 15/12/2024	VG	USD	23,462,233	15,661,040	0.51
Theta Capital 6.75% 31/10/2026	SG	USD	16,140,026	15,240,219	0.49
CIFI Holdings 4.45% 17/08/2026	KY	USD	19,487,880	14,956,948	0.48
China South City Holdings 10.875% 26/10/2022	HK	USD	15,672,424	14,888,803	0.48
CIFI Holdings Group 4.375% 12/04/2027	KY	USD	19,504,033	14,579,264	0.47
Yida China Holdings 6.00% 30/04/2025	KY	USD	21,233,799	14,120,477	0.46
Yanlord Land HK Co 6.80% 27/02/2024	HK	USD	14,346,526	13,987,863	0.45

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
China South City Holdings 11.50% 12/02/2022	HK	USD	13,565,474	12,887,200	0.42
RKPF Overseas 2019 A 6.70% 30/09/2024	VG	USD	15,251,416	12,483,284	0.40
Yanlord Land HK Co 5.125% 20/05/2026	HK	USD	13,043,654	12,032,771	0.39
NWD MTN 4.125% 18/07/2029	VG	USD	12,979,042	11,555,760	0.37
CIFI Holdings Group 5.375% VRN (Perpetual)	KY	USD	13,106,786	11,533,972	0.37
Sunac China Holdings 6.50% 10/01/2025	KY	USD	45,782,408	10,644,410	0.34
New Metro Global 4.50% 02/05/2026	VG	USD	17,253,795	10,507,561	0.34
Times China Holdings 6.75% 08/07/2025	KY	USD	22,322,856	10,380,128	0.33
KWG Group Holding 5.20% 21/09/2022	KY	USD	14,112,486	9,822,290	0.32
Easy Tactic 11.75% 02/08/2023	VG	USD	44,446,081	9,733,692	0.31
CIFI Holdings 6.45% 07/11/2024	KY	USD	11,485,510	9,510,002	0.31
Powerlong Real Estate Holdings 5.95% 30/04/2025	KY	USD	21,829,179	8,622,526	0.28
Redsun Properties Group 9.70% 16/04/2023	KY	USD	34,652,683	8,489,907	0.27
Redsun Properties Group 10.50% 03/10/2022	KY	USD	17,212,652	8,176,010	0.26
Sunac China Holdings 7.00% 09/07/2025	KY	USD	34,940,916	7,861,706	0.25
RKPF Overseas 7.875% 01/02/2023	VG	USD	8,601,079	7,788,277	0.25
Jinke Properties Group Co 6.85% 28/05/2024	CN	USD	23,122,177	7,630,318	0.25
Times China 6.60% 02/03/2023	KY	USD	12,691,390	7,621,180	0.25
RKPF Overseas 5.90% 05/03/2025	VG	USD	9,433,536	7,240,239	0.23
Times China Holdings 5.75% 14/01/2027	KY	USD	17,776,575	7,159,515	0.23
Times China 6.75% 16/07/2023	KY	USD	12,691,390	7,056,413	0.23
Cifi Holdings 5.50% 23/01/2023	KY	USD	7,325,958	6,886,401	0.22
Shimao Group Holdings 3.45% 11/01/2031	KY	USD	32,201,940	6,762,407	0.22
Ronshine China Holdings 8.95% 22/01/2023	KY	USD	25,436,312	6,613,441	0.21
China Evergrande Grp 8.75% 28/06/2025 (Defaulted)	KY	USD	57,357,858	6,596,154	0.21
Powerlong Real Estate Holdings 6.95% 23/07/2023	KY	USD	12,693,238	6,029,288	0.19
Sunac China 6.65% 03/08/2024	KY	USD	24,919,401	5,980,656	0.19
Powerlong Real Estate Holdings 4.90% 13/05/2026	KY	USD	15,685,866	5,803,771	0.19
China Aoyuan Group 6.20% 24/03/2026 (Defaulted)	KY	USD	22,497,401	4,949,428	0.16
China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted)	KY	USD	21,895,220	4,871,687	0.16
Kaisa Group Holdings 11.50% 30/01/2023 (Defaulted)	KY	USD	23,349,873	4,850,936	0.16
Kaisa Group Holdings 8.50% 30/06/2022 (Defaulted)	KY	USD	21,523,725	4,579,173	0.15
Sunac China Holdings 6.50% 09/07/2023	KY	USD	17,356,340	4,556,039	0.15
Yuzhou Group Hldgs 8.30% 27/05/2025 (Defaulted)	KY	USD	33,637,686	4,549,497	0.15
APL Realty Holdings Pte 5.95% 02/06/2024	SG	USD	9,216,733	4,285,781	0.14
Times China Holdings 6.20% 22/03/2026	KY	USD	9,786,213	4,257,003	0.14
China Evergrande 12.00% 22/01/2024 (Defaulted)	KY	USD	34,310,104	4,117,213	0.13
China Evergrande Grp 9.50% 11/04/2022 (Defaulted)	KY	USD	34,184,095	4,102,091	0.13
KWG Group Holdings 7.40% 13/01/2027	KY	USD	11,756,230	4,085,290	0.13
Scenery Journey 11.50% 24/10/2022 (Defaulted)	VG	USD	33,605,597	4,074,679	0.13
Easy Tactic 11.625% 03/09/2024	VG	USD	18,492,362	3,911,135	0.13
Kaisa Group Holdings 9.375% 30/06/2024 (Defaulted)	KY	USD	18,295,576	3,800,906	0.12
China Evergrande Grp 8.25% 23/03/2022 (Defaulted)	KY	USD	28,870,213	3,608,777	0.12
Yuzhou Grp Hlds 5.375% VRN (Perpetual) (Defaulted)	KY	USD	38,986,398	3,528,269	0.11
Yuzhou Group Holdings 6.35% 13/01/2027 (Defaulted)	KY	USD	24,313,891	3,403,945	0.11
Redsun Properties Group 7.30% 21/05/2024	KY	USD	16,671,852	3,334,370	0.11

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
Yango Justice 10.25% 15/09/2022	HK	USD	36,505,859	3,240,260	0.10
Yango Justice Intl 8.25% 25/11/2023 (Defaulted)	HK	USD	34,920,807	3,224,238	0.10
Yango Justice International 7.875% 04/09/2024	HK	USD	34,164,115	2,976,036	0.10
Sunac China Holdings 5.95% 26/04/2024	KY	USD	12,412,077	2,966,486	0.10
Redsun Properties Group 7.30% 13/01/2025	KY	USD	12,386,763	2,949,598	0.10
Sunac China Holdings 6.50% 26/01/2026	KY	USD	12,412,077	2,718,245	0.09
Yuzhou Group Hldgs 8.50% 26/02/2024 (Defaulted)	KY	USD	19,745,971	2,715,071	0.09
Modernland O/S Pte 3.00% 30/04/2027 (Defaulted)	SG	USD	5,894,453	2,701,428	0.09
Ronshine China Holdings 7.10% 25/01/2025	KY	USD	15,343,912	2,570,105	0.08
Ronshine China Holdings 8.75% 25/10/2022	KY	USD	6,416,079	2,502,271	0.08
Yuzhou Group Hldgs 7.375% 13/01/2026 (Defaulted)	KY	USD	19,292,563	2,411,570	0.08
China Aoyuan Group 8.50% 23/01/2022 (Defaulted)	KY	USD	9,713,037	2,408,833	0.08
Yango Justice Internl 9.25% 15/04/2023 (Defaulted)	HK	USD	25,164,937	2,353,677	0.08
Lodha Developers International 14.00% 12/03/2023	MU	USD	2,262,278	2,287,728	0.07
Kaisa Group Holdings 10.50% 15/01/2025 (Defaulted)	KY	USD	10,433,713	2,167,604	0.07
China Everg. Grp 11.50% 22/01/2023 (Defaulted)	KY	USD	17,913,366	2,149,604	0.07
Yango Justice International 7.50% 17/02/2025	HK	USD	24,573,254	2,088,727	0.07
Ronshine China Holdings 6.75% 05/08/2024	KY	USD	11,053,792	1,989,683	0.06
Sunac China Holdings 7.25% 14/06/2022	KY	USD	5,140,994	1,876,463	0.06
Scenery Journey 13.00% 06/11/2022 (Defaulted)	VG	USD	14,734,901	1,701,881	0.05
Sunac China Holdings 7.95% 08/08/2022	KY	USD	5,044,267	1,551,112	0.05
Easy Tactic 8.625% 27/02/2024	VG	USD	6,698,112	1,458,514	0.05
Yango Justice 7.50% 15/04/2024 (Defaulted)	HK	USD	16,266,616	1,420,571	0.05
China Evergrande Grp 7.50% 28/06/2023 (Defaulted)	KY	USD	9,646,486	1,157,578	0.04
Easy Tactic 8.125% 11/07/2024	VG	USD	5,160,020	1,135,204	0.04
Redco Properties Group 8.00% 23/03/2023 EMTN	KY	USD	3,878,991	1,037,630	0.03
Easy Tactic 9.125% 28/07/2022	VG	USD	4,039,552	999,789	0.03
Kaisa Grp Hlds 11.95% 22/10/2022 Reg S (Defaulted)	KY	USD	4,660,434	997,333	0.03
JGC Ventures 3.00% 30/06/2025 (Defaulted)	SG	USD	1,679,196	864,786	0.03
Jababeka International 6.50% 05/10/2023 Reg S	NL	USD	729,618	612,879	0.02
RKPF Overseas 2020 5.20% 12/01/2026	VG	USD	647,143	470,851	0.02
KWG Group Holdings 6.00% 14/08/2026	KY	USD	1,042,540	367,756	0.01
CIFI Holdings Group 6.00% 16/07/2025	KY	USD	282,181	223,205	0.01
Sunac China Holdings 7.50% 01/02/2024	KY	USD	804,233	195,027	0.01
Seazen Group 6.15% 15/04/2023	KY	USD	224,727	169,669	0.01
China South City Holdings 10.75% 11/04/2023	HK	USD	139,636	127,418	0.00
KWG Group Holdings 6.30% 13/02/2026	KY	USD	270,545	96,787	0.00
New Metro Global 4.625% 15/10/2025	VG	USD	118,545	73,498	0.00
Ronshine China Holdings 8.10% 09/06/2023	KY	USD	293,817	61,041	0.00
China Aoyuan Group 5.375% 13/09/2022 (Defaulted)	KY	USD	235,636	55,492	0.00
China Aoyuan Group 5.88% 01/03/2027 (Defaulted)	KY	USD	165,818	35,651	0.00
Kaisa Grp Holdings 10.875% 23/07/2023 (Defaulted)	KY	USD	145,454	30,945	0.00
Kaisa Grou 11.25% 16/04/2025 (Defaulted)	KY	USD	143,272	29,550	0.00
Shimao Group Holdings 5.60% 15/07/2026	KY	USD	119,272	29,520	0.00
Sunac China Holdings 8.35% 19/04/2023	KY	USD	107,636	26,640	0.00
KWG Group Holdings 7.40% 05/03/2024 EMTN	KY	USD	52,363	21,469	0.00

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
Kaisa Group Holdings 9.95% 23/07/2025 (Defaulted)	KY	USD	87,272	18,131	0.00
Yuzhou Group Holdings 7.85% 12/08/2026 (Defaulted)	KY	USD	125,091	16,887	0.00
JGC Ventures Pte 0.00% 30/06/2025	SG	USD	7,611	4,184	0.00
				922,637,865	29.75
国債					
Pakistan 7.375% 08/04/2031 Reg S	PK	USD	27,472,668	21,126,481	0.68
Sri Lanka 7.85% 14/03/2029 Reg S (Defaulted)	LK	USD	34,223,635	14,747,649	0.48
Sri Lanka 5.75% 18/04/2023 Reg S (Defaulted)	LK	USD	30,570,915	13,391,941	0.43
Sri Lanka 6.85% 14/03/2024 Reg S (Defaulted)	LK	USD	23,626,148	10,218,309	0.33
Pakistan 6.00% 08/04/2026 Reg S	PK	USD	12,403,503	10,175,834	0.33
Sri Lanka 6.20% 11/05/2027 Reg S (Defaulted)	LK	USD	18,924,462	8,184,830	0.26
Sri Lanka 7.55% 28/03/2030 Reg S (Defaulted)	LK	USD	17,445,654	7,501,631	0.24
Sri Lanka 6.35% 28/06/2024 Reg S (Defaulted)	LK	USD	8,756,563	3,787,214	0.12
				89,133,889	2.87
オープンエンド型ファンド					
Fidelity ILF - The US Dollar Fund - A-ACC-USD	IE	USD	14,682	266,901,813	8.61
				266,901,813	8.61
コミュニケーション・サービス					
CAS Capital 4.00% VRN (Perpetual)	VG	USD	26,920,109	25,237,603	0.81
SoftBank Group 6.00% VRN (Perpetual)	JP	USD	21,462,482	19,791,241	0.64
SoftBank Group 4.625% 06/07/2028	JP	USD	17,880,359	15,444,160	0.50
SoftBank Group 5.25% 06/07/2031	JP	USD	17,239,872	14,902,353	0.48
SoftBank Group 5.125% 19/09/2027	JP	USD	12,356,078	11,352,146	0.37
Bharti Airtel 1.50% 17/02/2025 Reg S	IN	USD	4,481,677	6,055,240	0.20
SoftBank Group 6.25% 15/04/2028	JP	USD	3,835,966	3,658,552	0.12
				96,441,295	3.11
その他の市場で取引される証券					
公益事業					
ReNew Power 4.50% 14/07/2028 Reg S	IN	USD	8,732,613	7,617,782	0.25
Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026 Reg S	NL	USD	3,728,628	3,403,865	0.11
				11,021,647	0.36
素材					
China Forestry 10.25% 17/11/2015 Reg S (Defaulted)	KY	USD	12,023,190	330,638	0.01
				330,638	0.01
一般消費財・サービス					
Studio City Finance 5.00% 15/01/2029 Reg S	VG	USD	63,823,327	45,072,353	1.45
Wynn Macau 5.125% 15/12/2029 Reg S	KY	USD	52,852,252	41,737,424	1.35
MGM China Holdings 4.75% 01/02/2027 Reg S	KY	USD	25,475,227	21,433,710	0.69
Melco Resorts Finance 5.625% 17/07/2027 Reg S	KY	USD	21,146,834	18,082,975	0.58
Studio City 7.00% 15/02/2027 Reg S	VG	USD	3,165,348	2,949,724	0.10
				129,276,186	4.17
金融					
HDFC Bank 3.70% VRN (Perpetual) Reg S	IN	USD	39,102,955	35,779,203	1.15
Citi Global Mkts Fdg Lux -3.44% 25/07/2024	LU	HKD	233,233,238	32,146,630	1.04
Bangkok Bank 3.733% VRN 25/09/2034 Reg S	TH	USD	34,565,644	31,542,014	1.02
King Talent Management 5.60% VRN (Perpetual)	KY	USD	10,189,440	9,629,021	0.31

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	% Net Assets
Stoneway Cap. 10.00% 01/03/2027 Reg S (Defaulted)	CA	USD	17,041,867	4,729,118	0.15
				113,825,986	3.67
不動産					
China SCE Group Holdings 5.95% 29/09/2024	KY	USD	28,224,924	17,572,838	0.57
Yuzhou Group Hldgs 8.375% 30/10/2024 (Defaulted)	KY	USD	11,064,446	1,521,361	0.05
Bakrieland Development WTS 31/12/2049	ID	IDR	71,065,556	0	0.00
				19,094,199	0.62
コミュニケーション・サービス					
Bakrie Tele. 11.50% 07/05/2015 Reg S (Defaulted)*	SG	USD	15,686,783	118,435	0.00
				118,435	0.00
非上場 素材					
Pearl Holding II 6.00% (Perpetual) Reg S	KY	USD	7,454,713	335,462	0.01
Mirabela Nickel 1.00% 15/04/2044	AU	USD	138,535	1	0.00
				335,463	0.01
資本財・サービス					
BLT Finance 7.50% 31/12/2049 (Defaulted)	NL	USD	156,567,816	225,270	0.01
				225,270	0.01
コミュニケーション・サービス					
Hellas Tel. II 6.054% 15/01/2015 144A (Defaulted)	LU	USD	364,809	4	0.00
				4	0.00
その他					
				(3)	(0.00)
投資資産合計 (取得価額 USD 4,566,133,276)				2,959,904,848	95.45

	通貨	契約額等	未実現(損)益 (米ドル)	% Net Assets
クレジット・デフォルト・スワップ				
Sold protection on CDX NA HY S38 5 Year 20/06/2027	USD	385,762,123	7,011,003	0.23
Sold protection on iTraxx Xover S37 20/06/2027	EUR	118,244,123	3,826,666	0.12
			10,837,669	0.35
		契約額等 USD	未実現(損)益 (米ドル)	% Net Assets
外国為替先物取引				
Bought USD Sold CNY at 0.156386 07/07/2022		1,635,223	66,462	0.00
			66,462	0.00
A Shares (EUR) (hedged)				
Bought USD Sold EUR at 1.061893 10/05/2022		54,417,696	403,815	0.01
Bought USD Sold EUR at 1.083765 10/05/2022		1,163,062	32,764	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.082897 10/05/2022		1,157,370	31,651	0.00
Bought EUR Sold USD at 0.899402 10/05/2022		1,380,918	(71,761)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.910190 10/05/2022		1,998,594	(81,132)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.940519 08/06/2022		54,241,671	(394,981)	(0.01)
Bought EUR Sold USD at 0.897825 10/05/2022		56,543,885	(3,032,375)	(0.10)
			(3,112,019)	(0.10)

	契約額等 USD	未実現(損)益 (米ドル)	% Net Assets
A Shares (RMB) (hedged)			
Bought USD Sold CNY at 0.151793 10/05/2022	25,978,612	222,941	0.01
Bought USD Sold CNY at 0.156610 10/05/2022	669,369	27,168	0.00
Bought USD Sold CNY at 0.152066 10/05/2022	547,042	5,687	0.00
Bought CNY Sold USD at 6.364550 10/05/2022	649,410	(27,358)	(0.00)
Bought CNY Sold USD at 6.383300 10/05/2022	948,005	(37,262)	(0.00)
Bought CNY Sold USD at 6.600110 08/06/2022	26,153,200	(227,122)	(0.01)
Bought CNY Sold USD at 6.365830 10/05/2022	26,785,478	(1,123,250)	(0.04)
		(1,159,196)	(0.04)
A-ACC Shares (SEK) (hedged)			
Bought SEK Sold USD at 9.830802 08/06/2022	19,062,595	63,255	0.00
Bought USD Sold SEK at 0.105948 10/05/2022	382,222	14,884	0.00
Bought SEK Sold USD at 9.531990 10/05/2022	514,887	(14,392)	(0.00)
Bought SEK Sold USD at 9.301430 10/05/2022	471,594	(24,270)	(0.00)
Bought SEK Sold USD at 9.373210 10/05/2022	621,153	(27,420)	(0.00)
Bought USD Sold SEK at 0.101637 10/05/2022	19,354,895	(64,541)	(0.00)
Bought SEK Sold USD at 9.278866 10/05/2022	19,229,440	(1,033,876)	(0.03)
		(1,086,360)	(0.04)
A-HMDIST (G) Shares (AUD) (hedged)			
Bought USD Sold AUD at 0.715674 10/05/2022	104,660,561	829,784	0.03
Bought USD Sold AUD at 0.742758 10/05/2022	2,516,183	115,927	0.00
Bought USD Sold AUD at 0.720760 10/05/2022	3,355,384	50,639	0.00
Bought AUD Sold USD at 1.335857 10/05/2022	2,659,266	(136,906)	(0.00)
Bought AUD Sold USD at 1.309742 10/05/2022	2,591,198	(181,451)	(0.01)
Bought AUD Sold USD at 1.396711 08/06/2022	105,533,711	(815,520)	(0.03)
Bought AUD Sold USD at 1.337564 10/05/2022	111,189,584	(5,589,563)	(0.18)
		(5,727,090)	(0.18)
A-MDIST Shares (JPY) (hedged)			
Bought USD Sold JPY at 0.007819 10/05/2022	1,150,110	17,177	0.00
Bought USD Sold JPY at 0.007986 10/05/2022	23,417	859	0.00
Bought USD Sold JPY at 0.007828 10/05/2022	23,045	372	0.00
Bought JPY Sold USD at 121.551457 10/05/2022	29,100	(1,850)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 122.856190 10/05/2022	35,557	(1,903)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 127.778500 08/06/2022	1,168,351	(17,056)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 121.749700 10/05/2022	1,210,810	(75,140)	(0.00)
		(77,541)	(0.00)
A-MDIST Shares (SGD) (hedged)			
Bought USD Sold SGD at 0.725268 10/05/2022	187,100,353	423,798	0.01
Bought USD Sold SGD at 0.738446 10/05/2022	3,960,930	81,103	0.00
Bought USD Sold SGD at 0.727818 10/05/2022	3,901,737	22,585	0.00
Bought SGD Sold USD at 1.353885 10/05/2022	4,547,210	(92,259)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.355861 10/05/2022	5,758,776	(108,606)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.378865 08/06/2022	187,515,312	(424,070)	(0.01)
Bought SGD Sold USD at 1.353045 10/05/2022	188,803,329	(3,945,430)	(0.13)
		(4,042,879)	(0.13)

	契約額等 USD	未実現(損)益 (米ドル)	% Net Assets
A-MINCOME (G) Shares (SGD) (hedged)			
Bought USD Sold SGD at 0.725268 10/05/2022	20,693,626	46,873	0.00
Bought USD Sold SGD at 0.738446 10/05/2022	714,150	14,623	0.00
Bought USD Sold SGD at 0.734824 10/05/2022	587,080	9,082	0.00
Bought SGD Sold USD at 1.353885 10/05/2022	559,649	(11,355)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.355861 10/05/2022	753,617	(14,213)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.378865 08/06/2022	20,599,841	(46,587)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.353045 10/05/2022	21,149,112	(441,954)	(0.01)
		(443,531)	(0.01)
E-MDIST Shares (EUR) (hedged)			
Bought USD Sold EUR at 1.061893 10/05/2022	61,747,180	458,205	0.01
Bought USD Sold EUR at 1.073950 10/05/2022	1,354,798	25,550	0.00
Bought EUR Sold USD at 0.899402 10/05/2022	1,682,674	(87,442)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.910190 10/05/2022	2,374,889	(96,408)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.940519 08/06/2022	61,806,753	(450,069)	(0.01)
Bought EUR Sold USD at 0.897617 10/05/2022	62,599,054	(3,370,788)	(0.11)
		(3,520,952)	(0.11)
Y Shares (EUR) (hedged)			
Bought USD Sold EUR at 1.090927 10/05/2022	6,504,147	227,418	0.01
Bought USD Sold EUR at 1.061893 10/05/2022	16,536,060	122,708	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.089730 10/05/2022	590,491	19,976	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.083765 10/05/2022	533,571	15,031	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.068632 10/05/2022	458,205	6,330	0.00
Bought EUR Sold USD at 0.910190 10/05/2022	853,338	(34,641)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.899402 10/05/2022	1,054,479	(54,797)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.940519 08/06/2022	16,679,947	(121,461)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.897825 10/05/2022	24,096,350	(1,292,256)	(0.04)
		(1,111,692)	(0.04)
Y-ACC Shares (SGD) (hedged)			
Bought USD Sold SGD at 0.725268 10/05/2022	3,459,382	7,836	0.00
Bought USD Sold SGD at 0.733050 10/05/2022	72,797	948	0.00
Bought SGD Sold USD at 1.353885 10/05/2022	82,577	(1,675)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.355861 10/05/2022	120,661	(2,276)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.378865 08/06/2022	3,403,379	(7,697)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.353045 10/05/2022	3,404,026	(71,134)	(0.00)
		(73,998)	(0.00)
Y-MDIST Shares (SGD) (hedged)			
Bought USD Sold SGD at 0.725268 10/05/2022	10,727,732	24,299	0.00
Bought USD Sold SGD at 0.734824 10/05/2022	217,378	3,363	0.00
Bought SGD Sold USD at 1.353885 10/05/2022	257,260	(5,220)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.355861 10/05/2022	314,339	(5,928)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.378865 08/06/2022	10,563,688	(23,890)	(0.00)
Bought SGD Sold USD at 1.353045 10/05/2022	10,606,299	(221,640)	(0.01)
		(229,016)	(0.01)

	通貨	契約額等	未実現(損)益 (米ドル)	% Net Assets
先物取引				
US Treasury 10 Year Bond Future 21/06/2022	USD	(39,795,579)	2,366,890	0.08
US Treasury Note 5 Year Bond Future 30/06/2022	USD	(324,568)	24,926	0.00
US Treasury 20 Year Bond Future 21/06/2022	USD	18,990,196	(1,859,919)	(0.06)
US Ultra Bond Future 21/06/2022	USD	30,614,858	(4,519,734)	(0.15)
US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2022	USD	72,426,630	(6,257,467)	(0.20)
			(10,245,304)	(0.33)
トータルリターンズワップ				
Pay iBoxx USD Liquid LL receive 3m USD LIBOR 20/06/2022	USD	160,442,760	(3,291,841)	(0.11)
			(3,291,841)	(0.11)
その他資産（負債控除後）			164,185,591	5.29
Net Assets			3,100,873,151	100.00

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーヨーロピアン・ハイ・イールド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

設 定 形 態	ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て
投 資 目 的	主として、本店所在地が西ヨーロッパ、中央ヨーロッパ、東ヨーロッパ(ロシアを含む)にあるか、活動の大半がそれらの地域で営まれている発行体の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に投資を行い、高水準のインカムの確保と値上り益の追求を目指します。
決 算 日	4月30日

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

通貨	ユーロ
投資収益	
受取配当金および受取利息	131,776,249
スワップ取引に係る受取利息	13,136,693
デリバティブ収益	—
雑益	—
純利益	144,912,942
費用	
運用報酬	23,820,629
管理費	5,874,137
国税	1,066,068
保管費用	292,697
販売手数料	643,753
成功報酬	—
その他費用	394,255
費用合計	32,091,539
スワップ取引に係る支払利息	8,827,234
デリバティブ費用	91,075
差金決済取引に係る財務費用	—
還付ブローカー費用	—
管理費用の払戻	—
払戻費用	—
費用還付	—
総費用	41,009,848
純投資収益(損失)	103,903,094
有価証券に係る実現純(損)益	(12,058,419)
外貨取引に係る実現純(損)益	349,911
差金決済取引に係る実現純(損)益	—
外国為替予約取引に係る実現純(損)益	(34,658,839)
オプション取引に係る実現純(損)益	—
先物取引に係る実現純(損)益	(2,658,755)
スワップ取引に係る実現純(損)益	31,641,731
有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額	(209,259,487)
外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額	88,556
差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額	—
外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額	(20,444,822)
オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額	—
先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額	1,005,453
スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額	(16,111,135)
運用実績	(158,202,712)
受益者への分配金	(38,809,719)
設定解約	
当期設定額	1,426,175,476
当期解約額	(1,604,333,880)
調整勘定	(9,417,013)
設定解約に伴う増加(減少)額	(187,575,417)
純増加(減少)	(384,587,848)
純資産額	
期首	2,832,952,601
期末	2,448,364,753

投資資産明細表 2022年4月30日現在

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
公認の証券取引所で取引される証券					
エネルギー					
Harbour Energy 5.50% 15/10/2026 144A	GB	USD	19,720,575	18,210,957	0.74
Kosmos Energy 7.50% 01/03/2028 Reg S	US	USD	18,024,362	16,484,230	0.67
Tullow Oil 10.25% 15/05/2026 144A	GB	USD	16,123,251	15,210,690	0.62
Vollucas	FR	EUR	618,252	6,932,808	0.28
DTKE Finance 7.50% 31/12/2027	GB	USD	30,453,099	6,951,582	0.28
				63,770,067	2.60

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
公益事業					
EDF 3.375% VRN (Perpetual)	FR	EUR	41,652,585	35,299,566	1.44
ContourGlobal Pwr. Hrgs 4.125% 01/08/2025 Reg S	LU	EUR	26,753,840	26,319,090	1.07
EDF 4.00% VRN (Perpetual) EMTN	FR	GBP	14,720,592	17,307,698	0.71
Electricite de France SA 2.625% VRN (Perpetual)	FR	EUR	17,229,784	14,598,520	0.60
Teollisuuden Voima 1.125% 09/03/2026 EMTN	FI	EUR	14,897,072	14,011,292	0.57
Cullinan 4.625% 15/10/2026 Reg S	LU	EUR	15,814,774	12,635,542	0.52
Teollisuuden Voima 1.375% 23/06/2026 EMTN	FI	EUR	10,870,656	9,756,109	0.40
Cullinan 4.750% FRN 15/10/2026 Reg S	LU	EUR	9,528,238	8,970,798	0.37
SSE 4.00% VRN (Perpetual)	GB	EUR	8,218,440	8,117,567	0.33
Electricite de France 5.00% VRN (Perpetual) EMTN	FR	EUR	4,516,545	4,436,169	0.18
EDF 5.875% VRN (Perpetual) EMTN	FR	GBP	2,509,192	2,835,268	0.12
TXU Europe Funding 7.00% 30/11/2005 (Defaulted)*	GB	EUR	627,298	6	0.00
				154,283,625	6.30

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
素材					
Schoeller Packaging 6.375% 01/11/2024 Reg S	NL	EUR	22,775,935	22,319,755	0.91
Ashland Services 2.00% 30/01/2026 Reg S	LU	EUR	7,360,297	6,690,207	0.27
INEOS Syraluron Group 2.25% 16/01/2027 Reg S	DE	EUR	4,948,126	4,372,758	0.18
Solvay Finance 5.869% VRN (Perpetual)	FR	EUR	2,927,391	3,002,841	0.12
ArcelorMittal 6.750% 01/03/2041	LU	USD	2,694,036	2,752,312	0.11
				39,137,866	1.60

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
資本財・サービス					
Air France KLM 3.875% 01/07/2026	FR	EUR	22,499,087	20,151,307	0.82
IAG 0.625% 17/11/2022	ES	EUR	18,484,380	18,302,494	0.75
Autostrade Italia 6.25% 09/06/2022 EMTN	IT	GBP	14,446,254	17,312,303	0.71
Deutsche Lufthansa 2.875% 16/05/2027 EMTN	DE	EUR	17,397,064	15,461,640	0.63
Papric Holdings 3.50% 01/07/2026 Reg S	FR	EUR	15,024,379	12,127,090	0.50
Intrum 3.50% 15/07/2026 Reg S	SE	EUR	11,488,753	10,728,048	0.44
Trovis Perkins 3.75% 17/02/2026	GB	GBP	2,237,363	2,617,473	0.11
				96,700,355	3.95

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
情報技術					
Orano 3.375% 23/04/2026 EMTN	FR	EUR	33,957,730	34,080,929	1.39
Orano 3.75% 08/03/2028 EMTN	FR	EUR	18,066,181	17,039,558	0.70
IHS Netherlands 8.00% 18/09/2027 Reg S	NL	USD	13,561,447	12,818,113	0.52
Hurricane Finance 8.00% 15/10/2025 Reg S	GB	GBP	10,194,847	12,282,183	0.50
ams 2.125% 03/11/2027	AT	EUR	11,795,202	9,929,994	0.41
ams 6.00% 31/07/2025 Reg S	AT	EUR	7,469,864	7,496,590	0.30
Ennergizer 3.50% 30/06/2029 Reg S	NL	EUR	3,152,381	2,639,192	0.11
				96,286,914	3.93

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
一般消費財・サービス					
Alice France Holding 8.00% 15/05/2027 Reg S	LU	EUR	39,227,033	39,816,540	1.63
LHMFC Fincio 7.25% 02/10/2025 Reg S	LU	EUR	27,135,208	25,978,465	1.06
CEMS Education Doloware 7.125% 31/07/2026 Reg S	SU	USD	24,025,512	22,773,906	0.93
Albion Financing 8.75% 15/04/2027 144A	LU	USD	22,080,888	19,924,767	0.81
JLR Automotive 6.875% 15/11/2026 Reg S	GB	EUR	19,375,980	19,020,043	0.78
Arqiva Broadcast Finance 6.75% 30/09/2023	GB	GBP	15,877,330	18,889,073	0.77
Verisure Holding 3.25% 15/02/2027 Reg S	SE	EUR	20,815,419	18,805,482	0.77
Verisure Holdings 3.875% 15/07/2026 Reg S	SE	EUR	19,066,513	17,996,824	0.74
Rakuten Group 4.25% VRN (Perpetual) Reg S	JP	EUR	19,648,645	16,887,893	0.69
Volkswagen 4.375% VRN (Perpetual)	NL	EUR	18,149,821	16,729,144	0.68
Alice Finance 5.75% 15/08/2029 144A	LU	USD	19,996,586	16,015,961	0.65
Stonegate Financing 8.00% 13/07/2025	GB	GBP	9,522,383	11,441,091	0.47
VZ Secured Financing 3.50% 15/01/2032 Reg S	NL	EUR	12,944,084	11,082,855	0.45
JLR Automotive 5.875% 15/01/2028 144A	GB	USD	12,514,176	10,438,040	0.43
Albion Finance 5.25% 15/10/2026 Reg S	LU	EUR	10,870,020	10,354,596	0.42
Deuce Fincio 5.80% 15/06/2027 Reg S	GB	GBP	8,931,050	9,744,393	0.40
Ford Motor 6.625% 22/04/2030	US	USD	8,258,587	9,591,482	0.39
Virgin Media 5.25% 15/05/2029 Reg S	GB	GBP	7,527,576	8,382,556	0.34
Unilever Group 5.25% 01/02/2030 Reg S	FR	EUR	9,246,372	8,114,154	0.33
CE Investment 5.50% 15/04/2026 Reg S	DE	EUR	8,318,476	6,856,351	0.28
Renault 2.50% 02/06/2027 EMTN	FR	EUR	7,560,296	6,425,987	0.26
Stonegate Financing 8.25% 31/07/2025 Reg S	GB	GBP	3,588,144	4,344,654	0.18
Summer BC (B) 5.75% 31/10/2026 Reg S	LU	EUR	4,181,986	4,141,413	0.17
Circa Finance International 4.50% 15/05/2027 Reg S	LU	EUR	4,028,080	3,640,265	0.15
Ozon Holdings 1.875% 24/02/2026	CY	USD	13,215,077	5,586,070	0.14
Schoeffler 3.375% 12/10/2028 EMTN	DE	EUR	3,596,508	3,295,481	0.13
ZF Finance 3.75% 21/09/2028 EMTN	DE	EUR	3,596,508	3,205,928	0.13
ZF Europe Finance 3.00% 23/10/2029	NL	EUR	2,174,633	1,829,062	0.07
SES	LU	EUR	203,055	1,733,275	0.07
Waterford 9.875% 01/12/2010 Reg S (Defaulted)*	IE	EUR	1,940,442	19	0.00
				350,785,570	14.33

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
生活必需品					
Bellis Acquisition Co 3.25% 16/02/2026 Reg S	GB	GBP	34,058,860	35,719,536	1.46
Iceland Bondco 4.375% 15/05/2028 Reg S	GB	GBP	5,925,875	5,630,380	0.23
				41,339,916	1.69

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
ヘルスケア					
Organon Finance 2.875% 30/04/2028 Reg S	US	EUR	30,911,571	27,944,060	1.14
Boyer 3.375% VRN 25/03/2082	DE	EUR	17,982,542	17,999,697	0.74

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
Chrome Bidco 3.50% 31/05/2028 Reg S	FR	EUR	11,237,834	10,157,541	0.41
Nidra Healthcare Holding 3.50% 30/09/2024 Reg S	DE	EUR	10,112,880	9,398,395	0.38
Nidra Healthcare Holding 3.50% 30/09/2024 Reg S	DE	EUR	9,826,486	9,132,895	0.37
Chrome Holdco 5.00% 31/05/2029 Reg S	FR	EUR	5,505,655	6,315,072	0.26
Boyer 3.125% VRN 12/11/2079	FR	EUR	5,596,508	3,524,278	0.14
Boyer 3.75% VRN 03/07/2074	NL	EUR	3,136,490	3,138,221	0.13
Teva Pharmaceutical III 5.125% 09/05/2029	NL	USD	3,293,733	2,857,569	0.12
				92,267,728	3.77

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
金融					
Lincoln Financing 3.625% 01/04/2024 Reg S	LU	EUR	29,674,212	29,525,220	1.21
Newday Bondco 3.75% 01/02/2024 Reg S	GB	GBP	22,494,905	26,648,584	1.09
Co-Operative Bank 6.00% VRN 06/04/2027	GB	GBP	17,456,448	20,721,121	0.85
Gartunkelux Holdco 3.75% 01/11/2025 Reg S	LU	GBP	15,781,318	16,089,241	0.66
Gartunkelux Holdco 3.625% 01/11/2025 Reg S	LU	EUR	16,140,795	15,817,414	0.65
Commerzbank 6.125% VRN (Perpetual)	DE	EUR	15,716,916	13,429,011	0.55
Co-Operative Bank Finance 9.00% VRN 27/11/2025	GB	GBP	9,852,760	12,787,466	0.52
Intertrust Group 3.375% 15/11/2025 Reg S	NL	EUR	12,420,500	12,502,194	0.50
Intesa Sanpaolo 5.875% VRN (Perpetual) EMTN	IT	EUR	12,704,875	11,665,921	0.48
International Personal Finance 9.75% 12/11/2025	FR	EUR	9,936,400	9,704,077	0.40
UniCredit 9.25% VRN (Perpetual)	IT	EUR	4,990,600	9,555,278	0.39
Intesa Sanpaolo 6.375% VRN (Perpetual)	IT	EUR	7,971,703	7,615,199	0.31
Pinowis Financial 5.50% VRN 19/02/2030 EMTN	GR	EUR	7,527,576	6,785,018	0.28
UniCredit 7.50% VRN (Perpetual)	IT	EUR	6,886,629	6,759,528	0.28
Banco BPM 7.00% VRN (Perpetual)	IT	EUR	6,782,546	6,747,796	0.28
Deutsche Bank 4.00% VRN 24/06/2032 EMTN	DE	EUR	6,691,178	6,403,739	0.26
Istanbul Metropolitan 10.75% 12/04/2027 Reg S	TR	USD	4,407,755	4,488,547	0.18
Pinowis Financial Holdings 8.75% VRN (Perpetual)	GR	EUR	5,057,694	4,329,283	0.18
FCE Bank 2.727% 03/06/2022 EMTN	GR	GBP	3,484,431	4,157,475	0.17
Gartunkelux 6.250% FRN 01/05/2026 Reg S	LU	EUR	3,972,887	3,955,502	0.16
Vmed O2 UK Financing 4.50% 15/07/2031 Reg S	GB	GBP	3,642,510	3,765,318	0.15
Pinowis Financial 5.50% VRN (Perpetual)	GR	GBP	2,668,944	2,649,732	0.11
Lincoln Financing 3.875% FRN 01/04/2024 Reg S	LU	EUR	2,535,557	2,529,617	0.10
Eurobank Ergasias	GR	EUR	2,032,172	2,031,765	0.08
Banca Monte 10.50% 23/07/2029 EMTN	IT	EUR	2,418,025	1,777,248	0.07
				242,237,085	9.89

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
不動産					
Adler Group 3.25% 05/08/2025	LU	EUR	9,618,569	7,180,743	0.29
Corestate Capital Holding 3.50% 15/04/2023	LU	EUR	6,105,700	3,113,587	0.13
				10,294,330	0.42

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
国債					
Turkey 8.60% 24/09/2027	TR	USD	20,763,563	19,966,360	0.82
				19,966,360	0.82

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
オープンエンド型ファンド					
Fidelity IIF - The Euro Fund - A-ACCUR	IE	EUR	17,044	232,559,296	9.50
				232,559,296	9.50

	国コード	通貨	株数または額 面額	時価 EUR	% Net Assets
コミュニケーション・サービス					
Vodafone Group 6.25% VRN 03/10/2078	GB	USD	21,014,482	20,215,383	0.83
Celtnet Telecom 0.75% 20/11/2031	ES	EUR	25,419,124	19,775,225	0.81
Alice France 5.50% 15/10/2029 144A	FR	EUR	20,652,332	16,879,537	0

	国コード	通貨	株数または額 面価値	時価 EUR	% Net Assets		国コード	通貨	株数または額 面価値	時価 EUR	% Net Assets
資本財・サービス											
AA Bond 6.50% 31/01/2026 Reg S	GB	GBP	21,662,690	25,193,920	1.03						
Autotrade per Italia 2.00% 15/01/2030	IT	EUR	26,296,351	23,533,622	0.97						
Autotrade per Italia 1.875% 26/09/2029 EMTN	IT	EUR	21,074,702	19,028,897	0.78						
Socit Environnement 2.5% 15/01/2029	FR	EUR	15,060,170	14,648,804	0.58						
Autotrade per Italia 2.00% 04/12/2028	IT	EUR	10,747,705	9,926,935	0.41						
Apcoa Parking 4.625% 15/01/2027 Reg S	DE	EUR	9,774,975	9,071,793	0.37						
Autotrade per Italia 1.625% 12/06/2023 MTN	IT	EUR	6,965,517	6,976,104	0.28						
IAG 3.75% 25/03/2029	ES	EUR	5,687,500	4,916,020	0.20						
Autotrade per Italia 1.75% 24/06/2026 EMTN	IT	EUR	5,088,641	4,861,759	0.20						(2) (0.00)
XPO Logistics 6.25% 01/05/2025 144A	US	USD	4,237,189	4,121,744	0.17						
Ukraine Railways 7.875% 15/07/2026	GB	USD	15,014,168	3,775,805	0.15						
Intl Consolidated Airlines 1.50% 04/07/2027	ES	EUR	5,765,788	5,067,039	0.15						
				128,142,422	5.23						
情報技術											
Nokia 3.125% 15/05/2028 EMTN	FI	EUR	6,088,972	6,030,518	0.25						
				6,030,518	0.25						
一般消費財・サービス											
Faurecia 2.75% 15/02/2027	FR	EUR	46,795,592	41,043,451	1.68						
Faurecia 3.125% 30/06/2026 Reg S	GB	GBP	21,980,521	25,235,456	1.01						
Crisa Finance Intl 6.25% 20/12/2023 Reg S	LU	EUR	15,941,423	15,915,916	0.65						
Ziggo Bond 3.375% 28/02/2030 Reg S	NL	EUR	18,201,678	15,251,857	0.62						
JLR Automotive 7.75% 15/10/2025 144A	GB	USD	15,369,637	14,615,881	0.60						
Unicredit 8.75% 15/09/2026 Reg S	GB	EUR	12,335,925	12,715,510	0.50						
UPC Broadband Finance BV 4.875% 15/07/2031 144A	NL	USD	10,822,981	9,031,989	0.37						
CPUK Finance 4.875% 28/08/2023 Reg S	GB	GBP	5,127,115	5,888,633	0.24						
Coira Mezz	CY	EUR	169,348	24,725	0.00						
Johnston Press 8.625% 01/06/2019 Reg S (Defaulted)*	GB	GBP	3,416,367	41	0.00						
				159,201,595	5.69						
ヘルスケア											
Grifols Escrow Issuer 3.875% 15/10/2028 Reg S	ES	EUR	14,304,066	12,874,203	0.53						
				12,874,203	0.53						
金融											
BCC 5.25% VRN 27/11/2031 EMTN	ES	EUR	26,848,353	25,652,527	1.05						
Vivion Investments 5.00% 08/08/2024	LU	EUR	26,179,235	24,066,571	0.98						
Unicredit 8.00% VRN (Perpetual)	IT	EUR	20,366,274	19,532,506	0.80						
Castor 6.00% 15/02/2029 Reg S	IT	EUR	19,039,748	18,614,590	0.76						
Banco Com Portugues 4.00% VRN 17/05/2032 DMTN	PT	EUR	19,237,138	16,975,735	0.69						
Jerrid Finco 4.875% 15/01/2026 Reg S	GB	GBP	14,455,454	16,437,251	0.67						
Jaraco Finco 5.25% 15/01/2027 Reg S	GB	GBP	12,908,956	14,692,203	0.60						
doValue 3.375% 31/07/2026 Reg S	IT	EUR	12,469,847	11,750,025	0.48						
Hoist Finance 3.375% 27/11/2024 EMTN	SE	EUR	9,651,188	9,769,415	0.40						
Banco de Sabadell SA 5.75% VRN (Perpetual)	ES	EUR	10,371,326	9,608,266	0.39						
Banco de Sabadell 5.00% VRN (Perpetual)	ES	EUR	9,534,929	8,196,797	0.33						
Banca Monte 5.375% VRN 18/01/2028 EMTN	IT	EUR	12,688,147	8,125,537	0.33						
Yapi ve Kredi Bankasi 8.25% 15/10/2024 Reg S	TR	USD	7,987,594	7,791,518	0.32						
TBC Bank 10.775% VRN (Perpetual) Reg S	GE	USD	7,569,395	7,003,711	0.29						
TBC Bank 8.894% VRN (Perpetual) Reg S	GE	USD	6,691,178	6,191,126	0.25						
Banca Monte 8.00% VRN 22/01/2030	IT	EUR	8,542,962	5,745,296	0.24						
Banco Commercial Portugues 9.25% VRN (Perpetual)	PT	EUR	5,520,222	5,391,949	0.22						
Banco Commercial 1.75% VRN 07/04/2028 EMTN	PT	EUR	6,272,980	5,372,619	0.22						
Banco de Sabadell 5.625% 06/05/2026 EMTN	ES	EUR	5,018,384	5,295,657	0.22						
TBC Bank 5.75% 19/06/2024 Reg S	GE	USD	5,290,213	5,061,033	0.21						
Deutsche Bank 6.75% VRN (Perpetual)	DE	EUR	4,851,104	4,745,153	0.19						
Cooperative Rabobank UA 4.875% VRN (Perpetual)	NL	EUR	4,014,707	3,774,768	0.15						
Stoneyard Cop. 10.00% 01/03/2027 Reg S (Defaulted)	CA	USD	12,702,992	3,545,272	0.14						
Socovbank 7.60% VRN (Perpetual) Reg S	IE	USD	9,265,100	7,911,154	0.33						
Tinkoff Credit 6.00% VRN (Perpetual) Reg S	IE	USD	5,708,411	568,810	0.02						
Hel Telc.Fin. 8.011% 15/07/2015 Reg S (Defaulted)*	LU	EUR	8,084,767	81	0.00						
				244,513,450	9.99						
不動産											
Adler Real Estate 2.125% 06/02/2024	DE	EUR	14,632,771	12,107,886	0.49						
Adler Real Estate 1.875% 04/04/2025	DE	EUR	10,875,167	9,502,407	0.39						
Heimstaedten Bostad AB 3.625% VRN (Perpetual) EMTN	SE	EUR	3,974,754	3,536,118	0.14						
				24,946,411	1.02						
コミュニケーション・サービス											
Infrastructure Wireless 1.625% 21/10/2028 GMTN	IT	EUR	17,760,060	16,077,809	0.66						
Telecom Italia 5.30% 30/05/2024	IT	EUR	16,217,743	15,174,517	0.62						
Ilidat Holdco 6.50% 15/10/2026 144A	FR	EUR	13,553,818	12,378,061	0.51						
Silknets 8.375% 31/01/2027 Reg S	GE	USD	11,207,724	10,396,726	0.42						
Telecom Italia Capital 7.721% 04/06/2038	LU	USD	10,789,525	9,640,759	0.39						
Telecom Italia Capital 7.20% 18/07/2036	LU	USD	9,639,479	8,502,511	0.34						
Telefonica Europe BV 2.374% VRN (Perpetual)	NL	EUR	9,965,128	8,208,872	0.34						
Telecom Italia 5.00% 30/09/2025 EMTN	IT	EUR	5,853,108	5,594,752	0.23						
Telecom Italia 5.25% 17/03/2025 EMTN	IT	EUR	4,600,185	4,222,717	0.17						
Vodafone Group 7.00% VRN 04/04/2079	GB	USD	3,119,762	3,146,082	0.13						
				93,092,606	3.80						
JPIMedia											
	GB	GBP	159,752	2	0.00						
				29,148,469	1.19						
生活必需品											
Market Bidco Finco 5.50% 04/11/2027 Reg S	GB	GBP	16,686,126	17,809,647	0.73						
				17,809,647	0.73						
その他											
											(2) (0.00)
Total Investments (Cost EUR 2,591,782,528)											
				2,406,163,847	98.28						
契約額等											
										Unrealised % Net gain/(loss) Assets EUR	
クレジット・デフォルト・スワップ											
Bought protection on Rolls-Royce Pl 0.875% 20/12/2026	EA	EUR	14,804,232	1,218,422	0.05						
Bought protection on Deutsche Luftha 0.25% 20/12/2026	EUR	EUR	7,381,206	708,857	0.03						
Bought protection on Auchan Holding 2.875% 20/12/2026	EUR	EUR	14,804,232	665,976	0.03						
Bought protection on Continental 0.375% 20/12/2026	EUR	EUR	11,575,003	629,011	0.03						
Sold protection on Intrum Just 5.125% 20/04/2024	EUR	EUR	10,036,567	459,546	0.02						
Sold protection on Vertical H 6.625% 20/06/2026	EUR	EUR	8,365,973	437,840	0.02						
Bought protection on Alstom 0.25% 20/12/2026	EUR	EUR	14,887,872	304,620	0.01						
Bought protection on Carrefour 1.25% 20/04/2027	EUR	EUR	7,402,116	118,795	0.00						
Bought protection on Carrefour 1.25% 20/04/2027	EUR	EUR	11,048,808	96,015	0.00						
Bought protection on Compagnie De 0.875% 20/12/2026	EUR	EUR	7,381,206	(84,110)	(0.00)						
Bought protection on Michelin Comp 1.125% 20/12/2026	EUR	EUR	7,402,116	(146,402)	(0.01)						
Sold protection on Air France 1.875% 20/12/2026	EUR	EUR	3,742,878	(152,325)	(0.01)						
Bought protection on CNX NA HV 5.8% 5 Year 20/06/2027	USD	USD	13,022,688	(224,680)	(0.01)						
Bought protection on Goodyear Tire 5% 20/12/2026	USD	USD	7,381,206	(233,638)	(0.01)						
Bought protection on Carlsberg Brew 2.625% 20/12/2026	EUR	EUR	22,227,258	(474,419)	(0.02)						
Sold protection on Rolls-Royce 2.125% 20/06/2025	EUR	EUR	11,876,841	(490,752)	(0.02)						
Bought protection on Itron Xaver 5.37 20/06/2027	EUR	EUR	42,884,481	(1,315,825)	(0.05)						
Sold protection on Adler Real Est 1.5% 20/06/2026	EUR	EUR	14,703,864	(2,129,649)	(0.09)						
				(614,718)	(0.03)						
契約額等 EUR											
										Unrealised % Net gain/(loss) Assets EUR	
外国為替先物取引											
Bought RUB Sold USD at 118.00000 18/05/2022				6,118,466	3,820,279	0.16					
Bought USD Sold EUR at 1.120441 18/05/2022				16,385,202	1,025,513	0.04					
Bought USD Sold EUR at 1.138309 18/05/2022				11,549,877	918,688	0.04					
Bought USD Sold EUR at 1.143287 18/05/2022				11,985,806	690,594	0.03					
Bought USD Sold EUR at 1.122724 18/05/2022				9,897,887	640,983	0.05					
Bought USD Sold EUR at 1.135170 18/05/2022				8,263,074	616,981	0.05					
Bought											

	契約額等 EUR	Unrealised gain/(loss) EUR	% Net Assets		契約額等 EUR	Unrealised gain/(loss) EUR	% Net Assets
Bought EUR Sold SEK at 0.095895 06/05/2022	44,702,494	(397,401)	(0.02)				
		30,267	0.00				
A-ACC Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	27,779,646	1,610,397	0.07				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	28,494,153	207,674	0.01				
Bought EUR Sold USD at 0.936561 06/05/2022	645,989	(8,378)	(0.00)				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	28,744,054	(210,270)	(0.01)				
		1,599,423	0.07				
A-HMDIST (G) Shares (AUD) (hedged)							
Bought AUD Sold EUR at 1.494082 06/05/2022	2,697,576	17,651	0.00				
Bought EUR Sold AUD at 0.674765 06/05/2022	2,715,228	4,346	0.00				
Bought AUD Sold EUR at 1.485448 07/06/2022	2,666,760	(3,555)	(0.00)				
		18,042	0.00				
A-MDIST Shares (SGD) (hedged)							
Bought SGD Sold EUR at 1.509307 06/05/2022	587,886	21,366	0.00				
Bought SGD Sold EUR at 1.464817 07/06/2022	540,614	2,302	0.00				
Bought EUR Sold SGD at 0.673900 06/05/2022	49,355	(1,119)	(0.00)				
Bought EUR Sold SGD at 0.683706 06/05/2022	548,896	(2,342)	(0.00)				
		20,207	0.00				
A-MDIST Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	32,967,265	1,911,125	0.08				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	34,278,862	249,835	0.01				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	34,878,590	(255,144)	(0.01)				
		1,905,816	0.08				
A-MINCOME (G) Shares (HKD) (hedged)							
Bought HKD Sold EUR at 8.758478 06/05/2022	1,486,884	84,446	0.00				
Bought HKD Sold EUR at 8.331675 07/06/2022	1,347,048	10,611	0.00				
Bought EUR Sold HKD at 0.120121 06/05/2022	1,571,330	(10,566)	(0.00)				
		84,471	0.00				
A-MINCOME (G) Shares (SGD) (hedged)							
Bought SGD Sold EUR at 1.509307 06/05/2022	207,314	7,534	0.00				
Bought SGD Sold EUR at 1.464817 07/06/2022	211,835	902	0.00				
Bought EUR Sold SGD at 0.683706 06/05/2022	214,848	(917)	(0.00)				
		7,519	0.00				
A-MINCOME (G) Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	1,670,790	96,856	0.00				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	1,706,846	12,440	0.00				
Bought EUR Sold USD at 0.921769 06/05/2022	40,422	(1,544)	(0.00)				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	1,727,224	(12,435)	(0.00)				
		95,507	0.00				
RY-ACC Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	33,812,301	1,960,112	0.08				
Bought USD Sold EUR at 1.100270 06/05/2022	17,736,192	780,585	0.03				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	33,122,364	387,172	0.02				
Bought EUR Sold USD at 0.948999 07/06/2022	2,725,882	4,388	0.00				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	54,289,189	(397,139)	(0.02)				
		2,735,118	0.11				
Y-ACC Shares (CHF) (hedged)							
Bought CHF Sold EUR at 1.031098 06/05/2022	2,889,347	18,775	0.00				
Bought EUR Sold CHF at 0.977539 06/05/2022	2,908,122	4,163	0.00				
Bought CHF Sold EUR at 1.022840 07/06/2022	2,858,609	(4,045)	(0.00)				
		18,893	0.00				
Y-ACC Shares (CZK) (hedged)							
Bought EUR Sold CZK at 0.040739 06/05/2022	484,788	868	0.00				
Bought EUR Sold CZK at 0.040766 06/05/2022	14,502	36	0.00				
Bought CZK Sold EUR at 24.557940 06/05/2022	499,952	(643)	(0.00)				
Bought CZK Sold EUR at 24.672610 07/06/2022	480,071	(952)	(0.00)				
		(711)	(0.00)				
Y-ACC Shares (SEK) (hedged)							
Bought SEK Sold EUR at 10.433524 07/06/2022	422,542	3,744	0.00				
Bought SEK Sold EUR at 10.344842 06/05/2022	428,155	385	0.00				
Bought EUR Sold SEK at 0.095895 06/05/2022	428,540	(5,810)	(0.00)				
		319	0.00				
Y-ACC Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	47,043,728	2,727,143	0.11				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	49,776,678	362,788	0.01				
Bought USD Sold EUR at 1.111640 06/05/2022	1,130,132	61,931	0.00				
Bought EUR Sold USD at 0.948999 07/06/2022	1,528,749	2,461	0.00				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	30,962,933	(372,807)	(0.02)				
		2,781,516	0.11				
Y-MDIST Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	1,380,830	80,047	0.00				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	1,391,457	10,141	0.00				
Bought EUR Sold USD at 0.923614 06/05/2022	51,998	(1,384)	(0.00)				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	1,408,879	(10,306)	(0.00)				
		78,498	0.00				
Y-MINCOME (G) Shares (USD) (hedged)							
Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022	43,588	2,527	0.00				
Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022	46,338	330	0.00				
Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022	46,115	(337)	(0.00)				
		2,520	0.00				
通貨							
先物取引							
Euro-Bund Bond Future 08/06/2022	EUR	(85,427,402)	6,871,903	0.28			
Long Gilt Future 28/04/2022	GBP	(5,943,774)	261,530	0.01			
US Ultra Bond Future 21/06/2022	USD	3,218,666	(450,940)	(0.02)			
US Treasury 20 Year Bond Future 21/06/2022	USD	6,814,286	(633,355)	(0.03)			
US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2022	USD	12,816,207	(1,050,805)	(0.04)			
Euro-Solci Bond Future 08/06/2022	EUR	28,933,458	(1,226,229)	(0.05)			
US Treasury Note 5 Year Bond Future 30/06/2022	USD	68,642,665	(2,870,411)	(0.12)			
			901,693	0.04			
通貨							
翌日物金利スワップ							
Receive fixed 1.93% pay float. (1d SOFR) 21/03/2027	USD	139,678,347	(4,622,174)	(0.19)			
			(4,622,174)	(0.19)			
その他資産 (負債控除後)							
			78,485,571	3.24			
Net Assets							
			2,448,364,753	100.00			

フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド (適格機関投資家専用)の運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

設 定 形 態	国内証券投資信託
運 用 方 針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り社債(ハイ・イールド債券)を主要な投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的に積極的な運用を行うことを基本とします。
主 な 投 資 対 象	フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
主 な 投 資 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ●公社債の実質投資割合には、制限を設けません。 ●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ●新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ●同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ●同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ●同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ●マザーファンド受益証券以外への投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。
決 算 日	毎月22日
分 配 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ●収益分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

■ 損益の状況

第194期 自2022年5月24日 至2022年6月22日 第197期 自2022年8月23日 至2022年9月22日
 第195期 自2022年6月23日 至2022年7月22日 第198期 自2022年9月23日 至2022年10月24日
 第196期 自2022年7月23日 至2022年8月22日 第199期 自2022年10月25日 至2022年11月22日

項 目	第194期	第195期	第196期	第197期	第198期	第199期
(A) 有価証券売買損益	681,254,625円	368,090,371円	439,592,583円	407,268,512円	99,017,248円	△224,298,361円
売 買 益	681,342,664	368,528,540	439,604,455	407,443,127	100,770,893	36,895
売 買 損	△88,039	△438,169	△11,872	△174,615	△1,753,645	△224,335,256
(B) 信託報酬等	△10,959,549	△10,942,425	△11,598,082	△11,783,547	△12,136,325	△13,526,801
(C) 当期損益金(A+B)	670,295,076	357,147,946	427,994,501	395,484,965	86,880,923	△237,825,162
(D) 前期繰越損益金	△71,305,201	517,986,830	796,006,847	1,127,711,300	1,441,364,548	1,450,322,751
(E) 追加信託差損益金	△4,571,557,441	△4,571,557,441	△4,571,250,049	△4,502,493,728	△4,496,091,451	△4,495,615,000
(配当等相当額)	(4,003,714)	(4,003,714)	(4,003,445)	(3,943,230)	(3,937,623)	(3,937,206)
(売買損益相当額)	(△4,575,561,155)	(△4,575,561,155)	(△4,575,253,494)	(△4,506,436,958)	(△4,500,029,074)	(△4,499,552,206)
(F) 合 計(C+D+E)	△3,972,567,566	△3,696,422,665	△3,347,248,701	△2,979,297,463	△2,967,845,980	△3,283,117,411
(G) 収益分配金	△81,003,045	△79,074,402	△79,069,084	△79,779,264	△77,769,013	△77,760,771
次期繰越損益金(F+G)	△4,053,570,611	△3,775,497,067	△3,426,317,785	△3,059,076,727	△3,045,614,993	△3,360,878,182
追加信託差損益金	△4,571,557,441	△4,571,557,441	△4,571,250,049	△4,502,493,728	△4,496,091,451	△4,495,615,000
(配当等相当額)	(4,003,714)	(4,003,714)	(4,003,445)	(3,943,230)	(3,937,623)	(3,937,206)
(売買損益相当額)	(△4,575,561,155)	(△4,575,561,155)	(△4,575,253,494)	(△4,506,436,958)	(△4,500,029,074)	(△4,499,552,206)
分配準備積立金	715,660,236	796,060,374	1,144,932,264	1,443,417,001	1,450,476,458	1,459,476,427
繰越損益金	△197,673,406	—	—	—	—	△324,739,609

(注1) (A) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (B) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、純資産総額に対して年0.33%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

	第194期	第195期	第196期	第197期	第198期	第199期
(a) 費用控除後の配当等収益	79,597,821円	73,436,627円	76,583,542円	78,796,217円	73,574,747円	86,914,447円
(b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	86,037,913円	351,410,959円	316,688,748円	13,306,176円	0円
(c) 収益調整金	4,003,714円	4,003,714円	4,003,445円	3,943,230円	3,937,623円	3,937,206円
(d) 分配準備積立金	717,065,460円	715,660,236円	796,006,847円	1,127,711,300円	1,441,364,548円	1,450,322,751円
(e) 分配可能額(a+b+c+d)	800,666,995円	879,138,490円	1,228,004,793円	1,527,139,495円	1,532,183,094円	1,541,174,404円
1万円当たり分配可能額	415.15円	455.83円	636.76円	803.97円	807.77円	812.60円
(f) 分配金額	81,003,045円	79,074,402円	79,069,084円	79,779,264円	77,769,013円	77,760,771円
1万円当たり分配金額(税引前)	42円	41円	41円	42円	41円	41円

■ 組入資産の明細 (2022年11月22日現在)

● 親投資信託残高

	第 193 期 末	第 199 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド	千口 3,449,808	千口 3,274,930	千円 15,596,531

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

<フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド>

ご参考として、フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)の主たる投資対象であるフィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンドの情報を掲載いたします。

■組入資産の明細 (2022年11月22日現在)

(1) 外国株式

上場、登録株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ・・・NASDAQ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CHARTER COMMUNICATIONS INC A	111.85	111.85	4,127	586,484	メディア・娯楽	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,039.45	2,013.32	19,746	2,805,997	エネルギー	
FRONTIER COMMS PARENT INC	1,629.41	1,629.41	3,957	562,408	電気通信サービス	
NORTHEAST GROCERY INC PP	15,955.32	15,955.32	1,771	251,664	食品・生活必需品小売り	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,069.98	2,069.98	10,053	1,428,658	消費者サービス	
(アメリカ・・・ニューヨーク証券取引所)						
NRG ENERGY INC	942	—	—	—	公益事業	
SFL CORP LTD	742.6	742.6	733	104,257	エネルギー	
VISTRA CORP	9,470.3	4,869.3	11,140	1,583,130	公益事業	
DENBURY INC	2,024.68	2,024.68	18,199	2,586,198	エネルギー	
CALIFORNIA RES CORP	4,812.29	4,812.29	21,385	3,038,924	エネルギー	
VALARIS LTD	846.83	846.83	5,383	764,966	エネルギー	
NOBLE CORPORATION	179.08	—	—	—	エネルギー	
SOUTHEASTERN GROCERS INC	10,482.76	10,482.76	22,674	3,222,005	小売	
PG&E CORP 5.5% PC 08/16/23	1,416	1,416	18,938	2,691,191	エネルギー	
NOBLE CORPORATION 144A	35.88	—	—	—	エネルギー	
NOBLE CORP PLC	—	214.96	794	112,958	エネルギー	
(アメリカ・・・OTC)						
MESQUITE ENERGY INC	1,867.42	1,867.42	10,351	1,470,892	エネルギー	
EP ENERGY CORP	5,665.55	5,665.55	4,742	673,847	エネルギー	
CHESAPEAKE ENERGY CORP PIPE	70.13	70.13	687	97,741	エネルギー	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A	906.42	906.42	7,504	1,066,354	エネルギー	
INTELSAT SA/LUXEMBOURG	1,961.59	1,961.59	9,423	1,339,076	電気通信サービス	
NEW COTAI LLC / CAP P/P	49,669.43	49,669.43	0	0	各種金融	
JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN	3,365.6	3,365.6	21,405	3,041,681	エネルギー	
PURE WEST ENERGY	77.89	77.89	0	0	エネルギー	
INTELSAT JACKSON CVR SER A RT	205.42	205.42	178	25,424	電気通信サービス	
INTELSAT JACKSON CVR SER B RT	205.42	205.42	659	93,729	電気通信サービス	
PURE WEST ENERGY CVR	46.94	46.94	0	0	エネルギー	
小 計	株 数 、 金 額	117,800.24	111,231.11	193,860	27,547,593	
	銘柄 数 <比 率>	26銘柄	24銘柄	—	<4.6%>	
合 計	株 数 、 金 額	117,800.24	111,231.11	—	27,547,593	
	銘柄 数 <比 率>	26銘柄	24銘柄	—	<4.6%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国新株予約権証券

銘 柄	期 首 (前期末)	当 期 末				
		証 券 数	証 券 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		証券	証券	千アメリカ・ドル	千円	
NOBLE CORP PLC TR 1 WT 2/04/28		—	72,804	1,397	198,632	
NOBLE CORP PLC TR2 WT 2/04/28		—	72,804	1,317	187,252	
NOBLE CORPORATION TRANCHE 1 WT		72,804	—	—	—	
NOBLE CORPORATION TRANCHE 2 WT		72,804	—	—	—	
DENBURY INC WT 09/18/25		315,827	313,027	19,094	2,713,349	
CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24		46,818	46,818	564	80,166	
小 計		証券数、金額	508,253	505,453	22,374	3,179,401
		銘柄数 <比率>	4	4	—	<0.5%>
合 計		証券数、金額	508,253	505,453	—	3,179,401
		銘柄数 <比率>	4	4	—	<0.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末								
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%	
	4,012,813	3,459,039	491,529,560	81.5	71.3	49.9	27.7	3.9	
合 計	—	—	491,529,560	81.5	71.3	49.9	27.7	3.9	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価については証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債

銘 柄	当 期 末						
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	新株予約権付社債	15.0000	1,469	8,710	1,237,769	2023/07/31	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	新株予約権付社債	15.0000	2,536	15,034	2,136,432	2023/07/15	
DISH NETWK CV 2.375% 3/15/24	新株予約権付社債	2.3750	41,113	36,426	5,176,151	2024/03/15	
DISH NETWORK CO CV 0% 12/15/25	新株予約権付社債	0.0000	7,197	4,737	673,239	2025/12/15	
DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	新株予約権付社債	3.3750	51,366	32,694	4,645,882	2026/08/15	
NEW COTAI LLC CONV 5% 2/24/27	新株予約権付社債	5.0000	5,802	5,628	799,829	2027/02/24	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	社債券	0.0000	6,605	0	0	2023/04/15	
WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 144	社債券	0.0000	6,530	0	0	2023/07/15	

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 144A	社債券	0.0000	4,985	0	0	2023/07/15
WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	社債券	0.0000	13,820	0	0	2049/12/31
CSC HLDGS LLC 4.625% 12/01/30 144A	社債券	4.6250	12,335	7,878	1,119,498	2030/12/01
TOPS MARKETS CORP ESCROW	社債券	0.0000	20,640	0	0	2049/12/31
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	社債券	0.0000	5,980	7	1,062	2049/12/31
TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A	社債券	5.3750	4,829	4,768	677,649	2023/05/15
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	社債券	7.0000	65,967	64,580	9,176,871	2023/06/30
INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23	社債券	0.0000	17,015	0	0	2023/08/01
AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A	社債券	3.9500	25	23	3,360	2024/07/01
CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A	社債券	9.2500	6,335	6,350	902,454	2024/08/01
OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24	社債券	6.9500	5,975	6,154	874,535	2024/07/01
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	社債券	4.2500	601	567	80,598	2024/09/15
INFRABUILD AUST 12% 10/24 144A	社債券	12.0000	13,890	13,542	1,924,424	2024/10/01
INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A	社債券	0.0000	3,835	0	0	2024/10/15
HERTZ 5.5% 10/15/24 144A	社債券	0.0000	6,520	146	20,846	2024/10/15
CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 144A	社債券	7.0000	9,835	7,517	1,068,247	2024/10/15
WOLVERINE 8.5% 11/24 144A	社債券	8.5000	3,807	1,903	270,481	2024/11/15
NABORS IND 5.75% 02/01/25	社債券	5.7500	8,875	8,451	1,200,918	2025/02/01
EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02	社債券	6.7500	20,670	18,885	2,683,637	2025/02/07
CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A	社債券	5.2500	11,525	10,975	1,559,649	2025/02/15
SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25	社債券	6.8750	6,965	6,741	957,976	2025/03/15
SYMANTEC CORP 5% 04/25 144A	社債券	5.0000	6,265	6,091	865,623	2025/04/15
CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A	社債券	7.5000	2,345	2,258	320,898	2025/04/15
CRESTWOOD MID P/F 5.75% 4/1/25	社債券	5.7500	8,145	7,920	1,125,494	2025/04/01
WYNN RESORTS LTD 7.75% 04/15/2	社債券	7.7500	11,430	11,235	1,596,591	2025/04/15
SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A	社債券	9.2500	4,215	4,113	584,582	2025/04/15
ARCONIC ROLLED 6% 5/15/25 144A	社債券	6.0000	3,335	3,282	466,501	2025/05/15
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	社債券	6.8750	11,205	11,023	1,566,372	2025/05/01
SUGARHOUSE 5.875% 5/15/25 144A	社債券	5.8750	5,585	5,235	744,026	2025/05/15
MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75	社債券	6.7500	7,465	7,487	1,063,948	2025/05/01
VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A	社債券	13.0000	4,665	4,952	703,803	2025/05/15
UBER TECH 7.5% 05/15/25 144A	社債券	7.5000	10,860	10,977	1,559,918	2025/05/15
ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A	社債券	11.5000	2,795	3,001	426,460	2025/06/01
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	社債券	7.2500	29,085	28,555	4,057,758	2025/06/15
CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A	社債券	7.0000	12,675	12,516	1,778,603	2025/06/15
FORD MTR CR 5.125% 6/16/25	社債券	5.1250	16,150	15,621	2,219,871	2025/06/16
VICI PPTY LP 4.625% 06/25 RGS	社債券	4.6250	10,630	10,182	1,446,975	2025/06/15
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	社債券	8.5000	27,100	20,191	2,869,274	2025/07/15
SP FINCO LLC 6.75% 7/1/25 144A	社債券	6.7500	2,735	2,623	372,837	2025/07/01
NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A	社債券	10.7500	10,515	9,785	1,390,515	2025/07/01
DPL INC 4.125% 07/01/25	社債券	4.1250	17,145	16,116	2,290,126	2025/07/01
WESTERN LO 10.375% 8/25 144A	社債券	10.3750	5,625	4,643	659,808	2025/08/15
SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A	社債券	8.0000	3,763	3,809	541,267	2025/09/20
OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25	社債券	5.8750	3,520	3,520	500,192	2025/09/01
NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25	社債券	6.7500	14,790	14,331	2,036,549	2025/09/15
SABRE GLBL INC 7.375% 09/01/25 144A	社債券	7.3750	5,275	4,903	696,814	2025/09/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A	社債券	8.0000	18,260	18,407	2,615,763	2025/09/20
EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A	社債券	8.5000	3,435	3,216	457,123	2025/10/30
NEW HOME CO 7.25% 10/15/25 144A	社債券	7.2500	3,440	2,736	388,864	2025/10/15
CANPACK SA 3.125% 11/01/25 144A	社債券	3.1250	3,435	2,979	423,438	2025/11/01
ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	社債券	7.0000	25,675	24,006	3,411,270	2025/11/15
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	社債券	11.5000	7,250	6,525	927,202	2025/11/01
ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	社債券	6.3750	13,815	13,473	1,914,642	2025/12/15
RP ESCROW ISS 5.25% 12/15/25 144A	社債券	5.2500	4,700	3,936	559,341	2025/12/15
ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A	社債券	6.5000	14,850	14,083	2,001,215	2026/01/15
LEGENDS HOSPITAL 5% 02/01/26 144A	社債券	5.0000	2,985	2,596	368,946	2026/02/01
NGL ENERGY OP 7.5% 02/01/26 144A	社債券	7.5000	17,125	15,459	2,196,832	2026/02/01
CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A	社債券	7.1250	8,730	8,424	1,197,114	2026/02/01
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	社債券	6.8750	8,650	8,265	1,174,491	2026/03/01
SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26	社債券	7.1250	9,765	9,278	1,318,420	2026/03/15
CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	社債券	8.0000	29,005	26,753	3,801,608	2026/03/15
OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26	社債券	5.5500	6,554	6,577	934,694	2026/03/15
NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A	社債券	5.8750	1,680	1,371	194,861	2026/03/15
MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A	社債券	3.3750	1,685	1,535	218,188	2026/04/01
FERRELLGAS/FG 5.375% 04/01/26 144A	社債券	5.3750	3,980	3,641	517,485	2026/04/01
USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26	社債券	6.8750	2,960	2,816	400,275	2026/04/01
CORECIVIC INC 0% 04/30/26	社債券	8.2500	8,245	8,387	1,191,895	2026/04/15
WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A	社債券	5.7500	3,610	3,384	480,919	2026/04/15
CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A	社債券	6.7500	4,950	4,580	650,921	2026/05/01
SEASPAN CORPORA 6.5% 4/26 144A	社債券	6.5000	4,600	4,519	642,220	2026/04/29
TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A	社債券	10.2500	12,297	10,759	1,528,978	2026/05/15
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	社債券	7.0000	7,640	7,506	1,066,645	2026/05/01
AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	社債券	4.3750	18	16	2,297	2026/05/01
ICAHN LP/FN COR 6.25% 05/15/26	社債券	6.2500	9,980	9,521	1,352,965	2026/05/15
EQT CORP 3.125% 05/15/26 144A	社債券	3.1250	3,875	3,575	508,133	2026/05/15
BLOCK INC 2.75% 06/01/26	社債券	2.7500	5,755	5,162	733,643	2026/06/01
CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A	社債券	6.3750	6,045	5,939	843,962	2026/06/15
BOBOMBARDIER 7.125% 06/26 144A	社債券	7.1250	7,380	7,191	1,021,977	2026/06/15
ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A	社債券	4.2500	9,705	7,944	1,128,970	2026/07/01
BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A	社債券	4.8750	3,655	3,479	494,461	2026/07/15
GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	社債券	7.1250	21,875	20,696	2,940,954	2026/07/31
ATR CANADA 3.875% 08/15/26 144A	社債券	3.8750	4,620	4,159	591,114	2026/08/15
TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A	社債券	5.5000	3,670	3,425	486,800	2026/08/15
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	社債券	0.0000	8,230	329	46,779	2026/08/01
ACRISURE 10.125% 08/01/26 144A	社債券	10.1250	5,055	4,966	705,744	2026/08/01
ROYAL CARIBBEAN 5.5% 08/31/26	社債券	5.5000	9,590	8,165	1,160,317	2026/08/31
DIAMOND SPORT 5.375% 08/15/26	社債券	5.3750	6,430	1,077	153,045	2026/08/15
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	社債券	6.7500	3,640	3,549	504,312	2026/09/15
RADIATE HOLDC 4.5% 9/15/26 144A	社債券	4.5000	14,100	11,717	1,665,039	2026/09/15
SBP LLC/C 6.375% 09/30/26 144A	社債券	6.3750	2,480	2,021	287,318	2026/09/30
IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A	社債券	5.0000	5,060	4,870	692,062	2026/10/15
KEHE DISTRS LLC / KEHE FIN COR	社債券	8.6250	4,048	3,984	566,155	2026/10/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
GANNETT HOLDING 6% 11/01/26 144A	社債券	6.0000	2,870	2,267	322,183	2026/11/01
RIVIAN 6ML+600 10/15/26 144A	社債券	10.1635	20,480	19,660	2,793,799	2026/10/15
CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A	社債券	4.5000	5,440	5,045	716,979	2026/11/01
KOBE US MID PIK VAR 11/26 144A	社債券	9.2500	12,375	8,662	1,230,941	2026/11/01
HERTZ 4.625% 12/01/26 144A	社債券	4.6250	3,580	3,050	433,519	2026/12/01
KRONOS ACQ K 5% 12/31/26 144A	社債券	5.0000	1,170	1,063	151,155	2026/12/31
ZIGGO BOND 6% 1/15/27 144A	社債券	6.0000	5,985	5,416	769,673	2027/01/15
SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27	社債券	6.6250	5,695	5,509	782,958	2027/01/15
ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A	社債券	4.6250	10,543	9,735	1,383,431	2027/01/15
VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A	社債券	5.6250	5,626	5,411	769,003	2027/02/15
TENET HEALTHCA 6.25% 2/27 144A	社債券	6.2500	13,060	12,482	1,773,724	2027/02/01
CENTURYLINK INC 4% 02/27 144A	社債券	4.0000	9,745	8,295	1,178,822	2027/02/15
VICI PROPERT 3.75% 02/27 144A	社債券	3.7500	4,530	4,073	578,865	2027/02/15
SBA COMMUNICATI 3.875% 02/27	社債券	3.8750	10,425	9,455	1,343,682	2027/02/15
LINDBLAD E 6.75% 02/15/27 144A	社債券	6.7500	4,725	4,347	617,708	2027/02/15
STUDIO CITY CO 7% 02/27 144A	社債券	7.0000	5,135	4,377	622,055	2027/02/15
NCL CORP 5.875% 02/15/27 144A	社債券	5.8750	6,415	5,633	800,450	2027/02/15
VICI PPTY LP 5.75% 02/01/27 RE	社債券	5.7500	6,005	5,799	824,041	2027/02/01
TRANSDIGM INC 7.5% 03/15/27	社債券	7.5000	16,800	16,737	2,378,327	2027/03/15
FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A	社債券	4.0000	9,450	6,884	978,329	2027/03/01
CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A	社債券	5.6250	5,130	4,302	611,426	2027/03/15
CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A	社債券	5.7500	11,865	8,661	1,230,792	2027/03/01
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	社債券	7.8750	13,585	13,182	1,873,249	2027/04/15
SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A	社債券	10.0000	5,555	5,516	783,839	2027/04/15
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	社債券	6.0000	9,955	9,729	1,382,550	2027/04/15
NORTHWEST FIN 4.75% 04/30/27 144A	社債券	4.7500	3,525	3,066	435,750	2027/04/30
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	社債券	5.1250	19,140	17,776	2,526,008	2027/05/01
CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027	社債券	5.3750	15,235	14,034	1,994,364	2027/05/15
ALTICE FR 10.5% 5/15/27 144A	社債券	10.5000	12,170	9,488	1,348,310	2027/05/15
ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	社債券	5.2500	13,520	12,269	1,743,481	2027/05/15
FORD MTR CR LLC 4.95% 05/28/27	社債券	4.9500	11,750	10,956	1,556,971	2027/05/28
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	社債券	4.7500	7,630	7,350	1,044,562	2027/06/01
ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A	社債券	7.2500	5,830	4,244	603,073	2027/06/30
UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A	社債券	6.6250	10,585	10,342	1,469,638	2027/06/01
WR GRACE 4.875% 06/15/27 144A	社債券	4.8750	6,725	5,934	843,336	2027/06/15
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	社債券	5.6250	3,000	2,931	416,631	2027/07/15
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	社債券	5.6250	6,745	6,366	904,742	2027/07/15
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	社債券	5.8750	5,375	4,703	668,314	2027/07/15
CAESARS E 8.125% 07/01/27	社債券	8.1250	12,020	11,930	1,695,334	2027/07/01
ROYAL CARI 5.375% 7/15/27 144A	社債券	5.3750	4,325	3,561	506,133	2027/07/15
SIRIUS XM RADIO 5% 8/1/27 144A	社債券	5.0000	8,735	8,125	1,154,641	2027/08/01
CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A	社債券	9.8750	19,185	18,465	2,623,956	2027/08/01
ALLEGIAN T 7.25% 8/15/27 144A	社債券	7.2500	3,405	3,246	461,341	2027/08/15
ROYAL CARIBBEAN 11.625% 08/15/27 144A	社債券	11.6250	17,750	17,832	2,534,028	2027/08/15
OLYMPUS WATER 7.125% 10/01/27 144A	社債券	7.1250	3,440	3,240	460,423	2027/10/01
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	社債券	6.8750	20,380	17,985	2,555,718	2027/09/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A	社債券	5.0000	1,210	1,113	158,185	2027/09/30
CABLEVS LT LLC 3.875% 9/15/27 144A	社債券	3.8750	2,645	2,237	317,961	2027/09/15
FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A	社債券	5.8750	5,005	4,673	664,092	2027/10/15
UBER TECH I 7.5% 09/15/27 144A	社債券	7.5000	5,815	5,880	835,607	2027/09/15
MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27	社債券	5.0000	11,630	9,769	1,388,203	2027/10/15
PERFORMANCE 5.5% 10/15/27 144A	社債券	5.5000	13,405	12,966	1,842,523	2027/10/15
LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A	社債券	4.7500	7,085	6,304	895,922	2027/10/15
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	社債券	6.7500	22,620	20,460	2,907,368	2027/10/15
LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A	社債券	6.7500	5,264	4,915	698,458	2027/10/15
FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A	社債券	6.8750	6,590	6,256	889,027	2027/10/15
MINERAL RES LT 8% 11/1/27 144A	社債券	8.0000	6,125	6,147	873,495	2027/11/01
TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	社債券	5.5000	27,775	25,796	3,665,616	2027/11/15
AVOLON HLDGS 2.528% 11/27 144A	社債券	2.5280	9,509	7,541	1,071,605	2027/11/18
FORD MTR CR LLC 7.35% 11/04/27	社債券	7.3500	30,000	30,816	4,379,038	2027/11/04
DISH NETWORK CO 11.75% 11/27 144A	社債券	11.7500	10,000	10,212	1,451,196	2027/11/15
MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	社債券	5.0000	7,545	6,969	990,393	2027/12/15
GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	社債券	5.2500	5,050	4,784	679,930	2027/12/01
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8	社債券	5.8750	5,860	5,396	766,797	2027/12/01
MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A	社債券	4.2500	1,720	1,548	219,970	2027/12/15
TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A	社債券	8.8750	7,700	6,044	858,923	2027/12/15
AFFINTY GME 6.875% 12/15/27 144A	社債券	6.8750	1,930	1,625	230,992	2027/12/15
KRONOS ACQ 7% 12/31/27 144A	社債券	7.0000	1,485	1,236	175,672	2027/12/31
OPEN TEXT CO 6.9% 12/1/27 144A	社債券	6.9000	3,970	3,989	566,957	2027/12/01
1375209 BC LTD 9% 1/30/28 144A	社債券	9.0000	2,267	2,227	316,503	2028/01/30
POST HLDGS 5.625% 01/28 144A	社債券	5.6250	13,375	12,639	1,796,055	2028/01/15
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	社債券	5.7500	11,850	11,553	1,641,787	2028/01/30
ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A	社債券	5.7500	5,390	5,053	718,049	2028/01/15
TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH	社債券	5.7500	7,155	6,599	937,817	2028/01/15
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	社債券	5.5000	11,490	9,373	1,332,012	2028/01/15
HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A	社債券	0.0000	8,095	475	67,580	2028/01/15
ALTICE FING 5% 01/15/28 144A	社債券	5.0000	5,480	4,411	626,859	2028/01/15
ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A	社債券	10.5000	16,865	6,746	958,606	2028/02/15
STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A	社債券	6.5000	10,530	6,229	885,173	2028/01/15
UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A	社債券	6.2500	4,435	4,290	609,731	2028/01/15
ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A	社債券	6.6250	85	73	10,486	2028/01/15
UNISYS 6.875% 11/01/27 144A	社債券	6.8750	2,905	2,059	292,605	2027/11/01
ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A	社債券	5.6250	2,255	2,170	308,419	2028/01/15
CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A	社債券	5.3750	2,325	2,063	293,214	2028/02/01
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	社債券	5.7500	8,810	7,973	1,132,970	2028/02/15
ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A	社債券	6.0000	6,000	3,862	548,861	2028/02/15
RADIOLOGY PAR 0% 01/31/28 144A	社債券	9.2500	9,925	6,026	856,331	2028/02/01
PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28	社債券	6.0000	20,275	18,334	2,605,271	2028/02/15
CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A	社債券	7.7500	3,180	2,400	341,167	2028/04/15
NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A	社債券	8.1250	7,995	7,772	1,104,483	2028/03/01
NORTHWEST FIN 6% 02/15/28 144A	社債券	6.0000	1,825	1,442	205,041	2028/02/15
FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28	社債券	2.9000	4,625	3,852	547,418	2028/02/16

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
ADTALEM GLOBA 5.5% 03/01/28 144A	社債券	5.5000	10,160	9,451	1,343,107	2028/03/01
BOMBARDIER INC 6% 02/28 144A	社債券	6.0000	7,710	7,016	996,987	2028/02/15
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	社債券	4.7500	3,445	3,169	450,445	2028/03/15
FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0	社債券	6.1250	5,210	2,942	418,070	2028/03/01
ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28	社債券	4.5000	1,668	1,492	212,135	2028/03/01
NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A	社債券	6.1250	2,075	1,635	232,365	2028/03/15
SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A	社債券	4.8750	3,985	3,185	452,726	2028/02/04
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	社債券	7.5000	20,300	15,771	2,241,069	2028/04/01
CDW LLC / CDW F 4.25% 04/01/28	社債券	4.2500	7,050	6,367	904,760	2028/04/01
ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A	社債券	6.2500	5,800	5,394	766,487	2028/04/01
UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A	社債券	4.7500	4,490	3,833	544,755	2028/04/15
MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A	社債券	5.2500	5,220	3,719	528,505	2028/05/01
ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A	社債券	4.1250	6,615	5,866	833,678	2028/04/30
SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A	社債券	4.8750	5,850	5,148	731,530	2028/05/01
ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A	社債券	4.6250	3,000	2,460	349,566	2028/06/01
VALARIS 12%/VAR 04/30/28 144A	社債券	8.2500	1,233	1,223	173,900	2028/04/30
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	社債券	4.2500	1,765	1,621	230,418	2028/05/01
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	社債券	4.6250	13,835	12,279	1,744,862	2028/05/15
NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A	社債券	10.7500	2,995	2,822	401,130	2028/06/01
MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A	社債券	4.3750	3,800	3,433	487,855	2028/06/15
FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A	社債券	5.0000	5,150	4,557	647,568	2028/05/01
ARCHES BUYER 4.25% 06/01/28 144A	社債券	4.2500	1,655	1,366	194,250	2028/06/01
ATLANTICA SUS 4.125% 6/28 144A	社債券	4.1250	2,790	2,400	341,125	2028/06/15
SRS DISTRIBUTIO 4.625% 07/01/28 144A	社債券	4.6250	4,110	3,629	515,769	2028/07/01
DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A	社債券	7.1250	3,425	3,108	441,673	2028/06/01
CARNIVAL 10.375% 05/28 144A	社債券	10.3750	11,435	11,736	1,667,713	2028/05/01
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	社債券	5.1250	6,815	6,243	887,161	2028/06/15
TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28	社債券	5.7000	1,630	1,437	204,208	2028/06/15
DANA INC 5.625% 6/15/28	社債券	5.6250	5,070	4,648	660,606	2028/06/15
CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A	社債券	6.1250	6,680	5,967	847,935	2028/06/15
MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28	社債券	6.1250	24,345	17,540	2,492,515	2028/06/15
SM ENERGY CO 6.5% 07/15/28	社債券	6.5000	2,040	1,948	276,839	2028/07/15
MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A	社債券	4.1250	3,975	3,334	473,827	2028/06/30
GEO GRP INC/THE 10.5% 06/30/28	社債券	10.5000	5,706	5,737	815,282	2028/06/30
LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28	社債券	4.2500	7,065	5,488	779,908	2028/07/01
PG&E CORP 5% 07/01/28	社債券	5.0000	7,060	6,499	923,640	2028/07/01
WINNEBAGO IND 6.25% 7/28 144A	社債券	6.2500	4,355	4,048	575,247	2028/07/15
AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A	社債券	4.6250	7,015	6,369	905,152	2028/07/15
GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A	社債券	7.1250	3,040	2,546	361,786	2028/08/15
CARNIVAL CORP 4% 08/01/28 144A	社債券	4.0000	10,645	8,713	1,238,228	2028/08/01
EMERGENT BIO 3.875% 08/15/30 144A	社債券	3.8750	3,395	1,631	231,797	2028/08/15
WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A	社債券	7.7500	22,330	19,585	2,783,119	2028/08/15
ON SEMICONDUCT 3.875% 09/01/28 144A	社債券	3.8750	6,575	5,804	824,750	2028/09/01
PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A	社債券	5.5000	18,495	16,359	2,324,668	2028/09/01
TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28	社債券	4.0000	1,800	1,505	213,896	2028/09/01
HCA INC 5.625% 09/01/28	社債券	5.6250	8,770	8,675	1,232,745	2028/09/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A	社債券	7.5000	12,085	11,600	1,648,415	2028/09/01
BOOZ ALLEN 3.875% 9/01/28 144A	社債券	3.8750	5,080	4,519	642,267	2028/09/01
OCCIDENTAL PETR 6.375% 9/01/28	社債券	6.3750	5,280	5,338	758,661	2028/09/01
BLACK KNIGHT 3.625% 09/28 144A	社債券	3.6250	5,650	4,950	703,510	2028/09/01
SOUTHWESTERN EN 8.375% 9/15/28	社債券	8.3750	5,280	5,448	774,222	2028/09/15
TENET HEALTH 6.125% 10/01/28 144A	社債券	6.1250	15,635	13,876	1,971,788	2028/10/01
WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28	社債券	4.8750	2,460	1,980	281,498	2028/09/15
RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A	社債券	6.5000	10,430	5,971	848,503	2028/09/15
ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A	社債券	5.1250	4,690	3,602	511,919	2029/01/15
CABLEVS LHT 5.625% 09/15/28 144A	社債券	5.6250	2,090	1,587	225,619	2028/09/15
COINBASE GLOBAL 3.375% 10/01/28 144A	社債券	3.3750	20,330	11,040	1,568,871	2028/10/01
GRIFOLS ES 4.75% 10/15/28 144A	社債券	4.7500	2,255	1,852	263,208	2028/10/15
BAUSCH HEALTH 11% 9/30/28 144A	社債券	11.0000	4,029	3,102	440,841	2028/09/30
SEG HLD LLC 5.625% 10/15/28 144A	社債券	5.6250	5,080	4,774	678,418	2028/10/15
UNITED NATURA 6.75% 10/15/28 144A	社債券	6.7500	3,695	3,593	510,620	2028/10/15
CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A	社債券	5.0000	2,990	2,226	316,390	2028/10/01
CHENIERE ENER 4.625% 10/15/28	社債券	4.6250	6,660	6,172	877,120	2028/10/15
VERTIV GROUP 4.125% 11/15/28 144A	社債券	4.1250	6,290	5,418	769,927	2028/11/15
LSB INDUS 6.25% 10/15/28 144A	社債券	6.2500	580	517	73,558	2028/10/15
CHOBANI LLC/FIN 4.625% 11/15/28	社債券	4.6250	2,990	2,601	369,687	2028/11/15
CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A	社債券	5.7500	7,290	6,460	918,001	2028/11/15
C AND S GRP 5% 12/15/28 144A	社債券	5.0000	3,920	2,920	414,983	2028/12/15
DISH DBS 5.75% 12/01/28 144A	社債券	5.7500	3,105	2,487	353,470	2028/12/01
GEO GRP IN 9.5% 12/31/28 144A	社債券	9.5000	13,485	12,654	1,798,179	2028/12/31
HOLOGIC INC 3.25% 02/15/29 144A	社債券	3.2500	5,215	4,478	636,377	2029/02/15
RACKSPACE INC 5.375% 12/01/28 144A	社債券	5.3750	2,980	1,348	191,614	2028/12/01
H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28	社債券	3.8750	8,460	7,161	1,017,633	2028/12/15
BIG RIV STL LLC 6.625% 01/31/2	社債券	6.6250	12,541	11,836	1,681,923	2029/01/31
LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2	社債券	4.8750	4,330	3,948	561,141	2029/01/15
EQT CORP 5% 01/15/29	社債券	5.0000	5,130	4,874	692,626	2029/01/15
STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A	社債券	3.8750	3,440	3,014	428,395	2029/01/15
CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A	社債券	6.0000	2,465	2,320	329,795	2029/01/15
ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A	社債券	5.6250	2,965	2,497	354,824	2029/01/15
CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A	社債券	6.0000	7,465	6,132	871,459	2029/01/15
SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A	社債券	3.8750	4,720	3,823	543,276	2029/01/15
REALOGY GROUP 5.75% 01/15/29 144A	社債券	5.7500	2,725	2,016	286,544	2029/01/15
CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29	社債券	3.0000	6,125	5,200	738,981	2029/02/15
CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A	社債券	6.8750	6,570	3,456	491,146	2029/04/15
UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A	社債券	6.5000	7,695	5,575	792,298	2029/02/15
REAL HERO 6.25% 02/01/29 144A	社債券	6.2500	1,595	1,163	165,358	2029/02/01
US FOODS INC 4.75% 02/15/29 144A	社債券	4.7500	7,250	6,450	916,560	2029/02/15
JAZZ SECU DAC 4.375% 01/15/29	社債券	4.3750	4,460	3,982	565,972	2029/01/15
TRANSDIGM INC 4.625% 01/15/29	社債券	4.6250	8,355	7,310	1,038,839	2029/01/15
FERTITTA ENTERT 4.625% 01/15/29 144A	社債券	4.6250	6,405	5,624	799,248	2029/01/15
MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A	社債券	5.6250	5,645	5,155	732,543	2029/02/15
CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 144A	社債券	6.0000	17,165	16,060	2,282,211	2029/02/01

銘柄	当期						期末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
				外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A	社債券	5.8750	7,390	6,909	981,861	2029/02/01		
CLEVELAND-CLIF 4.625% 3/1/29 144A	社債券	4.6250	3,385	2,961	420,882	2029/03/01		
AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A	社債券	5.3750	3,385	2,967	421,738	2029/03/01		
COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A	社債券	6.7500	7,995	7,630	1,084,283	2029/03/01		
ICAHN LP/FN CO 4.375% 02/01/29	社債券	4.3750	5,925	5,011	712,123	2029/02/01		
MERCER INTL 5.125% 02/01/29	社債券	5.1250	5,195	4,340	616,833	2029/02/01		
SOUTHWESTERN EN 5.375% 02/29	社債券	5.3750	10,290	9,492	1,348,887	2029/02/01		
JACOBS ENT 6.75% 02/15/29 144A	社債券	6.7500	2,750	2,459	349,540	2029/02/15		
NCL CORP 7.75% 02/15/29 144A	社債券	7.7500	5,710	4,581	651,035	2029/02/15		
HUDBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A	社債券	6.1250	9,850	8,819	1,253,263	2029/04/01		
ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A	社債券	3.5000	3,395	2,829	402,114	2029/03/15		
KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29	社債券	4.7500	5,095	4,028	572,386	2029/03/01		
TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A	社債券	4.0000	5,085	4,327	614,993	2029/03/01		
TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A	社債券	4.6250	5,040	4,075	579,156	2029/03/15		
CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A	社債券	3.7500	1,680	1,475	209,720	2029/03/15		
ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A	社債券	4.1250	6,035	5,235	743,945	2029/03/31		
CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A	社債券	4.2500	8,285	6,876	977,157	2029/03/15		
MATTEL INC 3.75% 04/01/29 144A	社債券	3.7500	1,685	1,459	207,413	2029/04/01		
TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A	社債券	6.2500	2,425	1,839	261,376	2029/04/01		
NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A	社債券	5.5000	3,975	3,468	492,829	2029/04/15		
ARCOSA INC 0% 03/31/29 144A	社債券	4.3750	3,160	2,711	385,308	2029/04/15		
MOZART DEBT 3.875% 04/01/29 144A	社債券	3.8750	9,715	8,220	1,168,180	2029/04/01		
CLYDESDALE ACQU 6.625% 3/29 144A	社債券	6.6250	2,320	2,244	318,918	2029/04/15		
DPL INC 4.35% 04/15/29	社債券	4.3500	22,705	20,135	2,861,186	2029/04/15		
TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A	社債券	4.0000	5,280	4,441	631,097	2029/04/15		
SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14	社債券	4.0000	5,575	4,769	677,757	2029/04/15		
MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A	社債券	7.8750	7,910	4,610	655,219	2029/05/01		
CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A	社債券	5.0000	1,855	1,678	238,553	2029/05/01		
UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A	社債券	4.6250	3,645	3,201	454,955	2029/04/15		
SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A	社債券	6.6250	3,900	3,238	460,127	2029/05/01		
HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A	社債券	6.7500	2,160	1,783	253,433	2029/04/15		
LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A	社債券	4.8750	5,860	4,935	701,313	2029/05/01		
NOVA CHEM CORP 4.25% 05/15/29 144A	社債券	4.2500	6,005	4,913	698,204	2029/05/15		
TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A	社債券	10.5000	4,280	2,486	353,393	2029/05/15		
ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A	社債券	6.0000	2,375	1,710	242,991	2029/06/01		
VICTORS MERGER 6.375% 05/15/29 144A	社債券	6.3750	7,820	4,829	686,212	2029/05/15		
DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	社債券	5.1250	9,305	9,029	1,283,115	2029/05/15		
HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29	社債券	3.7500	3,440	2,962	420,989	2029/05/01		
FRONTIER COMM 6.75% 05/01/29 144A	社債券	6.7500	5,810	4,837	687,428	2029/05/01		
GREAT LAKE 5.25% 06/01/29 144A	社債券	5.2500	3,140	2,457	349,173	2029/06/01		
CLEAR CHANNEL 7.5% 06/01/29 144A	社債券	7.5000	5,830	4,299	610,976	2029/06/01		
SRS DISTRIBUTIO 6.125% 07/01/29 144A	社債券	6.1250	2,260	1,891	268,844	2029/07/01		
DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A	社債券	4.1250	5,735	5,013	712,350	2029/06/15		
SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29	社債券	4.5000	4,765	4,104	583,232	2029/05/15		
NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A	社債券	5.2500	5,385	4,931	700,701	2029/06/15		
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	社債券	5.1250	3,060	2,860	406,444	2029/06/01		

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A	社債券	4.0000	2,730	2,252	320,044	2029/06/15
TENET HEALTH 4.25% 06/01/29 144A	社債券	4.2500	14,290	12,289	1,746,323	2029/06/01
MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A	社債券	5.8750	6,155	4,585	651,595	2029/06/30
AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A	社債券	5.7500	5,900	4,616	656,040	2029/07/15
ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A	社債券	4.1250	2,790	2,254	320,394	2029/07/15
VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A	社債券	4.6250	3,640	2,961	420,829	2029/07/15
CENTRAL PARENT 7.25% 06/15/29	社債券	7.2500	9,310	8,920	1,267,611	2029/06/15
LEVEL 3 FIN 3.75% 07/15/29 144A	社債券	3.7500	8,720	6,300	895,258	2029/07/15
LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A	社債券	5.1250	5,635	4,625	657,274	2029/07/15
ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A	社債券	5.1250	9,920	7,612	1,081,779	2029/07/15
COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29	社債券	5.8750	5,640	5,217	741,335	2029/07/01
SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A	社債券	5.5000	8,005	6,004	853,303	2029/08/01
PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A	社債券	4.2500	2,925	2,539	360,856	2029/08/01
AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A	社債券	4.8750	3,035	2,596	368,915	2029/06/30
VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 144	社債券	3.8750	4,765	4,133	587,389	2029/08/15
MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4	社債券	4.6250	8,370	6,633	942,581	2029/08/01
ASHTON WOODS US 4.625% 08/01/2	社債券	4.6250	2,985	2,324	330,253	2029/08/01
ALTICE FING SA 5.75% 8/29 144A	社債券	5.7500	15,990	12,931	1,837,624	2029/08/15
UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A	社債券	4.5000	27,145	23,698	3,367,503	2029/08/15
WR GRACE HLG 5.625% 08/29 144A	社債券	5.6250	5,070	4,101	582,877	2029/08/15
CCO HLDGS/CAP 6.375% 9/29 144A	社債券	6.3750	4,755	4,458	633,488	2029/09/01
TEGNA INC 5% 09/15/29	社債券	5.0000	13,405	12,596	1,789,988	2029/09/15
PAPA JOHNS IN 3.875% 09/15/29 144A	社債券	3.8750	1,830	1,535	218,235	2029/09/15
ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29	社債券	4.8750	2,540	2,155	306,342	2029/10/01
CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 144A	社債券	4.6250	6,000	4,956	704,273	2029/10/15
ROLLER BEARING 4.375% 10/15/29 144A	社債券	4.3750	1,440	1,256	178,526	2029/10/15
HEALTH EQUITY INC 4.5% 10/01/29 144A	社債券	4.5000	2,085	1,793	254,799	2029/10/01
QORVO INC 4.375% 10/15/29	社債券	4.3750	3,915	3,423	486,425	2029/10/15
THOR INDUSTRIES 4% 10/15/29 144A	社債券	4.0000	6,650	5,270	748,884	2029/10/15
ALLIANT HLDG 5.875% 11/01/29 144A	社債券	5.8750	6,220	5,159	733,110	2029/11/01
OPTION CARE HEA 4.375% 10/31/29	社債券	4.3750	2,165	1,851	263,037	2029/10/31
MSCI INC 4% 11/15/29 144A	社債券	4.0000	13,690	12,037	1,710,467	2029/11/15
FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A	社債券	5.8750	1,284	1,014	144,230	2029/11/01
CHEMOURS 4.625% 11/15/29 144A	社債券	4.6250	4,800	3,857	548,105	2029/11/15
AVANTOR FUNDING 3.875% 11/01/29	社債券	3.8750	4,710	4,009	569,733	2029/11/01
ASBURY AUTOMO 4.625% 11/15/29 144A	社債券	4.6250	3,075	2,633	374,223	2029/11/15
PECF USS INTERM 8% 11/29 144A	社債券	8.0000	1,765	1,037	147,496	2029/11/15
SRS DISTRIBUTIO 6% 12/01/29 144A	社債券	6.0000	3,575	2,920	415,021	2029/12/01
OPEN TEXT CORP 3.875% 12/01/29 144A	社債券	3.8750	4,655	3,682	523,280	2029/12/01
HERTZ 5% 12/01/29 144A	社債券	5.0000	4,675	3,646	518,167	2029/12/01
SPIRIT AE 9.375% 11/30/29 144A	社債券	9.3750	12,000	12,480	1,773,408	2029/11/30
TRANSALTA 7.75% 11/15/29 144A	社債券	7.7500	4,735	4,830	686,381	2029/11/15
UNITED RENTAL 6% 12/29 144A	社債券	6.0000	13,860	13,902	1,975,512	2029/12/15
CENTENE CORP 4.625% 12/15/29	社債券	4.6250	9,050	8,371	1,189,554	2029/12/15
COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A	社債券	5.8750	3,545	3,214	456,780	2030/01/15
UNITI GRP/UNI 6% 01/15/30 144A	社債券	6.0000	14,240	9,869	1,402,389	2030/01/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
HUB INTE 5.625% 12/01/29 144A	社債券	5.6250	4,185	3,703	526,311	2029/12/01
II-VI INC 5% 12/15/29 144A	社債券	5.0000	3,060	2,669	379,385	2029/12/15
COVERT M 4.875% 12/01/29 144A	社債券	4.8750	2,965	2,511	356,821	2029/12/01
CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A	社債券	5.7500	8,985	6,109	868,202	2030/01/15
JBS USA/LUX/FI 5.5% 01/30 144A	社債券	5.5000	10,595	10,002	1,421,329	2030/01/15
ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144	社債券	4.8750	4,150	3,550	504,501	2030/01/15
ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A	社債券	5.1250	2,840	2,272	322,851	2030/02/28
FRONTIER COMM 6% 01/31/30 144A	社債券	6.0000	6,275	4,983	708,170	2030/01/15
LAMB WESTON 4.125% 01/30 144A	社債券	4.1250	4,710	4,138	588,139	2030/01/31
TENET HEALTH 4.375% 01/15/30 144A	社債券	4.3750	14,020	11,987	1,703,366	2030/01/15
FERTITTA ENTERT 6.75% 07/15/30 144A	社債券	6.7500	11,205	9,277	1,318,366	2030/07/15
MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 144A	社債券	5.5000	1,300	1,046	148,705	2030/02/01
VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 144A	社債券	6.3750	9,445	7,738	1,099,570	2030/02/01
ERO COPPER 6.5% 2/15/30 144A	社債券	6.5000	20,070	15,466	2,197,767	2030/02/15
MINERVA MERGE 6.5% 02/15/30 144A	社債券	6.5000	18,835	13,884	1,973,027	2030/02/15
INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A	社債券	6.5000	23,650	21,575	3,065,833	2030/03/15
ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A	社債券	4.8750	15,497	13,666	1,941,942	2030/02/15
OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A	社債券	4.1250	7,655	6,200	881,098	2030/02/15
CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI	社債券	3.3750	4,895	4,160	591,242	2030/02/15
HESS INFRA/FI 4.25% 02/30 144A	社債券	4.2500	3,345	2,834	402,837	2030/02/15
GRAPHIC PACK 3.75% 02/30 144A	社債券	3.7500	2,510	2,120	301,308	2030/02/01
CCO HLDGS 4.75% 03/01/30 144A	社債券	4.7500	12,395	10,566	1,501,533	2030/03/01
ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30	社債券	4.7500	1,662	1,415	201,098	2030/03/01
MACYS RTL HLDG 5.875% 03/15/30	社債券	5.8750	2,010	1,763	250,632	2030/03/15
OWENS MINOR INC 6.625% 04/30 144A	社債券	6.6250	8,620	7,521	1,068,873	2030/04/01
CLYDESDALE ACQUI 8.75% 03/30 144A	社債券	8.7500	13,965	12,782	1,816,385	2030/04/15
CDI ESCROW ISSU 5.75% 04/01/30 144A	社債券	5.7500	9,515	8,689	1,234,842	2030/04/01
POST HLDGS IN 4.625% 4/30 144A	社債券	4.6250	1,416	1,226	174,250	2030/04/15
CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A	社債券	6.1250	12,790	6,187	879,250	2030/04/01
REALOGY GR 5.25% 04/15/30 144A	社債券	5.2500	7,925	5,563	790,585	2030/04/15
CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 144A	社債券	5.2500	10,895	8,280	1,176,616	2030/05/15
MINERAL RES 8.5% 5/1/30 144A	社債券	8.5000	1,465	1,477	209,950	2030/05/01
DAVITA INC 0% 05/31/30 144A	社債券	4.6250	14,645	11,458	1,628,300	2030/06/01
ROBLOX CO 3.875% 05/01/30 144A	社債券	3.8750	22,315	17,801	2,529,571	2030/05/01
US FOODS INC 4.625% 06/01/30 144A	社債券	4.6250	2,370	2,067	293,848	2030/06/01
FRONTIER COMM 8.75% 05/15/30 144A	社債券	8.7500	4,885	4,956	704,286	2030/05/15
DARLING INGRED 6% 6/15/30 144A	社債券	6.0000	4,950	4,807	683,130	2030/06/15
SIRIUS XM R 4.125% 7/1/30 144A	社債券	4.1250	4,755	3,992	567,373	2030/07/01
TENET HEALTH 6.125% 06/15/30 144A	社債券	6.1250	8,165	7,684	1,091,919	2030/06/15
ADVANCED DRAIN 6.375% 06/15/30 144A	社債券	6.3750	8,020	7,674	1,090,512	2030/06/15
UNIVISION COM 7.375% 06/30/30 144A	社債券	7.3750	7,630	7,458	1,059,827	2030/06/30
PG&E CORP 5.25% 07/01/30	社債券	5.2500	19,645	17,606	2,501,819	2030/07/01
OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30	社債券	8.8750	14,070	16,049	2,280,695	2030/07/15
PG&E 4.55% 07/01/30	社債券	4.5500	36,411	32,999	4,689,211	2030/07/01
DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30	社債券	8.1250	425	469	66,783	2030/08/16
VICI PROPE 4.125% 8/15/30 144A	社債券	4.1250	5,935	5,091	723,487	2030/08/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A	社債券	4.5000	12,200	10,105	1,435,940	2030/08/15
MATCH GROUP INC 4.125% 08/01/2	社債券	4.1250	5,750	4,743	674,086	2030/08/01
FMG RES AG 5.875% 4/15/30 144A	社債券	5.8750	9,275	8,553	1,215,504	2030/04/15
ENLINK MIDSTR 6.5% 9/1/30 144A	社債券	6.5000	4,735	4,735	672,843	2030/09/01
OCCIDENTAL PETE 6.625% 9/1/30	社債券	6.6250	17,605	18,318	2,602,988	2030/09/01
L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A	社債券	6.6250	10,425	9,669	1,373,991	2030/10/01
1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A	社債券	4.0000	10,310	8,557	1,215,992	2030/10/15
DANA INC 4.25% 09/01/30	社債券	4.2500	3,175	2,563	364,317	2030/09/01
CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30	社債券	4.1250	3,435	2,872	408,184	2030/10/15
HESS MIDSTREAM 5.5% 10/30 144A	社債券	5.5000	1,990	1,801	256,053	2030/10/15
BAUSCH HEALTH 14% 10/30 144A	社債券	14.0000	797	470	66,819	2030/10/15
MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A	社債券	3.8750	4,985	4,248	603,735	2030/11/15
FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30	社債券	4.0000	3,440	2,880	409,292	2030/11/13
CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A	社債券	4.1250	5,315	4,023	571,702	2030/12/01
SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30	社債券	4.0000	6,100	4,556	647,437	2030/09/15
TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A	社債券	6.0000	5,145	4,630	657,994	2030/12/31
CNX RESOURCES 7.375% 01/15/31 144A	社債券	7.3750	3,710	3,645	517,965	2031/01/15
OCCIDENTAL PETRO 6.125% 01/01/31	社債券	6.1250	12,810	12,954	1,840,870	2031/01/01
SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A	社債券	5.3750	2,450	1,874	266,330	2031/01/15
MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A	社債券	3.7500	2,245	1,850	262,950	2031/02/15
CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A	社債券	4.7500	26,430	19,169	2,724,011	2031/02/15
CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A	社債券	3.3750	7,020	4,951	703,646	2031/02/15
DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A	社債券	3.7500	5,275	3,798	539,695	2031/02/15
COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31	社債券	3.8750	2,620	2,124	301,843	2031/02/15
CLEVELAND-CLIF 4.875% 3/1/31 144A	社債券	4.8750	3,385	2,922	415,331	2031/03/01
KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31	社債券	5.0000	5,095	3,973	564,611	2031/03/01
CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A	社債券	4.0000	4,710	4,084	580,395	2031/03/15
FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A	社債券	4.3750	3,615	3,005	427,134	2031/04/01
ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A	社債券	5.1250	6,600	5,688	808,388	2031/04/30
SCOTTS MIRACLE 4% 04/01/31	社債券	4.0000	3,370	2,586	367,538	2031/04/01
OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	社債券	7.5000	22,290	23,906	3,397,046	2031/05/01
EQT CORP 3.625% 05/15/31 144A	社債券	3.6250	3,875	3,335	473,994	2031/05/15
BLOCK INC 3.5% 06/01/31	社債券	3.5000	5,755	4,668	663,363	2031/06/01
DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A	社債券	4.3750	5,735	4,906	697,167	2031/06/15
CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A	社債券	5.5000	16,265	14,577	2,071,463	2031/06/15
FORD MTR CR LLC 3.625% 6/17/31	社債券	3.6250	5,490	4,377	622,098	2031/06/17
MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A	社債券	7.2500	16,050	13,368	1,899,713	2031/06/30
VENTURE GLOBAL 4.125% 08/15/31 144A	社債券	4.1250	4,765	4,127	586,523	2031/08/15
CROCS INC 4.125% 08/15/31 144A	社債券	4.1250	8,120	6,475	920,196	2031/08/15
ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31	社債券	5.1250	1,780	1,485	211,064	2031/10/01
COINBASE GLOBAL 3.625% 10/01/31	社債券	3.6250	12,770	6,547	930,426	2031/10/01
ALLY 8% GLOBAL	社債券	8.0000	34,804	37,103	5,272,357	2031/11/01
ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	社債券	8.0000	18,070	19,143	2,720,296	2031/11/01
TENET HEALTH 6.875% 11/15/31	社債券	6.8750	725	631	89,758	2031/11/15
CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A	社債券	4.5000	4,930	3,722	528,896	2031/11/15
CSC HLDGS LLC 5% 11/15/31 144A	社債券	5.0000	5,185	3,280	466,202	2031/11/15

銘柄	当期						期末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
				外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32	社債券	4.7500	4,720	4,070	578,361	2032/02/01		
HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A	社債券	3.6250	3,430	2,761	392,476	2032/02/15		
YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32	社債券	4.6250	5,800	5,096	724,248	2032/01/31		
VZ SECURED FINA 5% 01/15/32 14	社債券	5.0000	15,310	12,669	1,800,268	2032/01/15		
NRG ENERGY INC 3.875% 02/15/32 144A	社債券	3.8750	2,945	2,361	335,503	2032/02/15		
ASBURY AUTOMO 5% 02/15/32 144A	社債券	5.0000	3,075	2,560	363,802	2032/02/15		
FORD MOTOR 3.25% 02/12/32	社債券	3.2500	9,450	7,366	1,046,801	2032/02/12		
BUILDERS F 4.25% 02/01/32 144A	社債券	4.2500	12,090	9,867	1,402,188	2032/02/01		
BELLRING BRANDS 7% 3/30 144A	社債券	7.0000	1,860	1,778	252,742	2030/03/15		
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	社債券	8.7500	44,955	53,046	7,537,964	2032/03/15		
MACYS RTL HLDG 6.125% 03/15/32	社債券	6.1250	2,345	1,976	280,898	2032/03/15		
CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32	社債券	4.5000	4,545	3,650	518,793	2032/05/01		
MOLINA HEALTHCA 3.875% 05/15/32 144A	社債券	3.8750	6,725	5,615	797,944	2032/05/15		
FORD MOTOR 6.1% 08/19/32	社債券	6.1000	9,770	9,328	1,325,551	2032/08/19		
CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A	社債券	4.5000	9,955	7,762	1,103,052	2033/06/01		
CCO HLDGS/ 4.25% 01/15/34 144A	社債券	4.2500	8,000	6,012	854,396	2034/01/15		
CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34	社債券	5.1500	5,115	4,823	685,476	2034/03/15		
OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36	社債券	6.4500	4,200	4,193	595,859	2036/09/15		
ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37	社債券	5.9500	3,730	3,518	499,943	2037/02/01		
OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39	社債券	4.3000	2,145	1,738	246,980	2039/08/15		
OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40	社債券	6.2000	2,405	2,326	330,650	2040/03/15		
PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42	社債券	3.7500	855	567	80,643	2042/08/15		
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	社債券	5.8500	5,575	5,461	776,093	2043/05/21		
CF INDUS INC 5.375% 03/15/44	社債券	5.3750	5,780	5,186	736,978	2044/03/15		
OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44	社債券	4.5000	1,985	1,602	227,770	2044/07/15		
OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46	社債券	6.6000	5,365	5,378	764,272	2046/03/15		
OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46	社債券	4.4000	4,275	3,398	482,944	2046/04/15		
KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46	社債券	4.3750	1,500	1,245	177,025	2046/06/01		
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	社債券	3.9500	5,170	3,549	504,334	2047/12/01		
KRAFT HEINZ FD 4.875% 10/01/49	社債券	4.8750	7,485	6,630	942,174	2049/10/01		
ALLIANT HLDG PREF A 9.75% PERP	社債券	9.7500	3,000	2,482	352,763	2049/12/31		
JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	社債券	5.1500	35,000	34,346	4,880,595	2049/12/31		
CITIGROUP 5.35% PERP	社債券	5.3500	25,370	24,727	3,513,832	2049/12/31		
BANK OF AMERICA 6.1% VAR PERP	社債券	6.1000	12,630	12,309	1,749,137	2049/12/31		
KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50	社債券	5.5000	1,990	1,936	275,169	2050/06/01		
PG&E 4.95% 07/01/50	社債券	4.9500	40,141	31,493	4,475,271	2050/07/01		
CITIGROUP INC 5%/VAR PERP	社債券	5.0000	5,310	4,797	681,782	2049/12/31		
BK OF AMERCA CORP 4.3%/VAR PRP	社債券	4.3000	6,295	5,416	769,734	2049/12/31		
CA MAGNUM HLD 5.375% 10/31/26 144A	社債券	5.3750	1,565	1,369	194,588	2026/10/31		
OPEN TEXT HOLDI 4.125% 12/01/31 144A	社債券	4.1250	4,655	3,613	513,510	2031/12/01		
STATION CAS LLC 4.625% 12/01/31 144A	社債券	4.6250	7,800	6,385	907,319	2031/12/01		
小計		—	4,012,813	3,459,039	491,529,560	—		
合計		—	—	—	491,529,560	—		

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(4) 金銭債権

(A) 金銭債権

区 分	当 期 末		
	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 187,556	千円 26,651,836	% <4.4>
合 計	—	26,651,836	<4.4>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)金銭債権

銘 柄	種 類	利 率	額 面 金 額	当 期 末		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	金銭債権	0.00000	1,814	0	0	2049/12/31
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	金銭債権	0.00000	1,638	0	0	2049/12/31
SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	金銭債権	0.00000	1,489	0	0	2049/12/31
USI TERM B INCR 05/16/24	金銭債権	6.42414	2,422	2,415	343,269	2024/05/16
CITGO TERM LOAN B 1LN 03/28/24 C1	金銭債権	10.00386	12,544	12,541	1,782,150	2024/03/28
INTERNET TM 1LN 09/15/2024 C1	金銭債権	7.50386	1,049	1,023	145,399	2024/09/15
SOFTBANK SVF II TERM 1LN 12/24 C1	金銭債権	5.00000	22,933	22,933	3,258,888	2024/12/31
KINDERCARE TERM 2LN 08/22/2025 C1	金銭債権	12.00386	13,635	13,094	1,860,729	2025/08/22
ALLIANT INSURAN TRM B EXT 5/25 C1	金銭債権	7.00386	355	348	49,473	2025/05/10
AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C1	金銭債権	7.16471	644	630	89,664	2025/10/01
ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1	金銭債権	7.00386	5,422	5,304	753,732	2025/05/10
MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25 C1	金銭債権	10.62071	3,431	2,624	372,972	2025/06/13
CONSOLIDATE TM INCR B 1LN 5/25 C1	金銭債権	7.35814	12,664	12,031	1,709,669	2025/05/07
ANASTASIA BEV TERM B 08/25 C1	金銭債権	7.42414	7,712	5,701	810,146	2025/08/10
AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C2	金銭債権	7.16471	2,481	2,430	345,424	2025/10/01
NUMERICABLE TERM B-12 01/01/26 C1	金銭債権	7.76664	15,472	14,276	2,028,698	2026/01/31
ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1	金銭債権	7.50386	1,901	1,853	263,368	2026/05/04
TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/2026 C1	金銭債権	10.42414	3,395	2,284	324,646	2026/05/29
THE GOLUB CORP TM 2LN 05/26 C1	金銭債権	18.06000	10,302	10,302	1,464,050	2026/05/08
UKG TERM 1LN 5/3/26 C1	金銭債権	6.99829	8,361	8,067	1,146,435	2026/05/03
SINCLAIR BROAD TM 1LN 05/26 C1	金銭債権	11.89387	936	885	125,892	2026/05/25
ANGUS CHEMICAL TM B 1LN 11/27	金銭債権	7.57643	2,000	1,931	274,488	2027/11/24
FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1	金銭債権	6.17414	2,461	2,398	340,851	2027/02/01
AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1	金銭債権	7.67414	515	507	72,147	2027/01/23
VEEAM SOFTWARE TERM B 1LN 2/27 C1	金銭債権	6.75386	1,082	1,060	150,711	2027/02/19
ACRISURE TERM B 1LN 02/15/27 C1	金銭債権	8.00386	456	436	61,956	2027/02/15
UKG TERM 2LN 05/03/2027 C1	金銭債権	8.99829	15,315	14,057	1,997,633	2027/05/03
ANGUS CHEMICAL TM 1LN 11/04/27 C1	金銭債権	8.54387	580	545	77,472	2027/11/04
AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2	金銭債権	7.67414	259	255	36,322	2027/01/23
AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C3	金銭債権	8.16986	86	84	12,053	2027/01/23

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C4	金銭債権	8.16986	170	168	23,941	2027/01/23
EPICOR SOFTWARE TL 2LN 07/28 C1	金銭債権	11.50386	4,075	4,022	571,576	2028/07/30
CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 2/28 C1	金銭債権	7.14414	3,384	3,040	432,043	2028/03/01
PAREXEL TERM B 1LN 08/11/28 C1	金銭債権	7.00386	2,412	2,324	330,296	2028/08/11
ALTERRA MOUNT TM B-1 1LN 07/28 C1	金銭債権	7.25386	277	273	38,844	2028/07/21
EXAMWORKS TERM B 1LN 11/01/28 C1	金銭債権	6.75386	597	579	82,303	2028/11/01
ECHO GLOBAL LOGIS TM 2LN 10/28 C1	金銭債権	10.75386	1,134	1,129	160,450	2028/10/25
GREAT OUTDOOR TM B1 1LN 3/5/28 C1	金銭債権	7.50386	6,185	5,902	838,793	2028/03/05
ASURION TM B10 1LN 8/17/28 C1	金銭債権	7.13409	9,480	8,427	1,197,484	2028/08/17
ECHO GLOBAL LOGIS TM 2LN 10/28 C2	金銭債権	11.41471	780	776	110,309	2028/10/25
USI INC TERM 1LN 11/16/29	金銭債権	0.00000	560	550	78,183	2029/11/16
ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1	金銭債権	9.50386	650	551	78,394	2029/11/18
AUTHENTIC BR TM B 2LN 12/20/29 C1	金銭債権	9.82872	370	340	48,370	2029/12/20
ATHENAHEALTH TM B 1LN 02/15/29 C1	金銭債権	7.41060	6,021	5,457	775,465	2029/02/15
SCIENTIFIC GAME TM B 1LN 02/29 C1	金銭債権	7.09736	1,005	964	137,009	2029/02/04
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C1	金銭債権	6.33990	2,498	2,162	307,345	2029/02/25
DEL MONTE FOODS TM B 1LN 05/29 C1	金銭債権	7.82647	4,135	3,995	567,752	2029/05/16
BAYER ENVIR SCI TERM 1LN 10/29 C1	金銭債権	7.96829	6,265	5,727	813,917	2029/10/04
HUB INTERNAT TM B 1LN 11/10/29 C1	金銭債権	8.22019	345	339	48,246	2029/11/10
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C2	金銭債権	6.33990	917	794	112,853	2029/02/25
小 計		—	204,631	187,556	26,651,836	—
合 計		—	—	—	26,651,836	—

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 決算日時点で受渡しが完了していない新規買付銘柄に関しましては、クーポンレートが確定しておりません。